

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

포커스농산물모(채권-파생형)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	5	0	5	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

스마트인덱스모

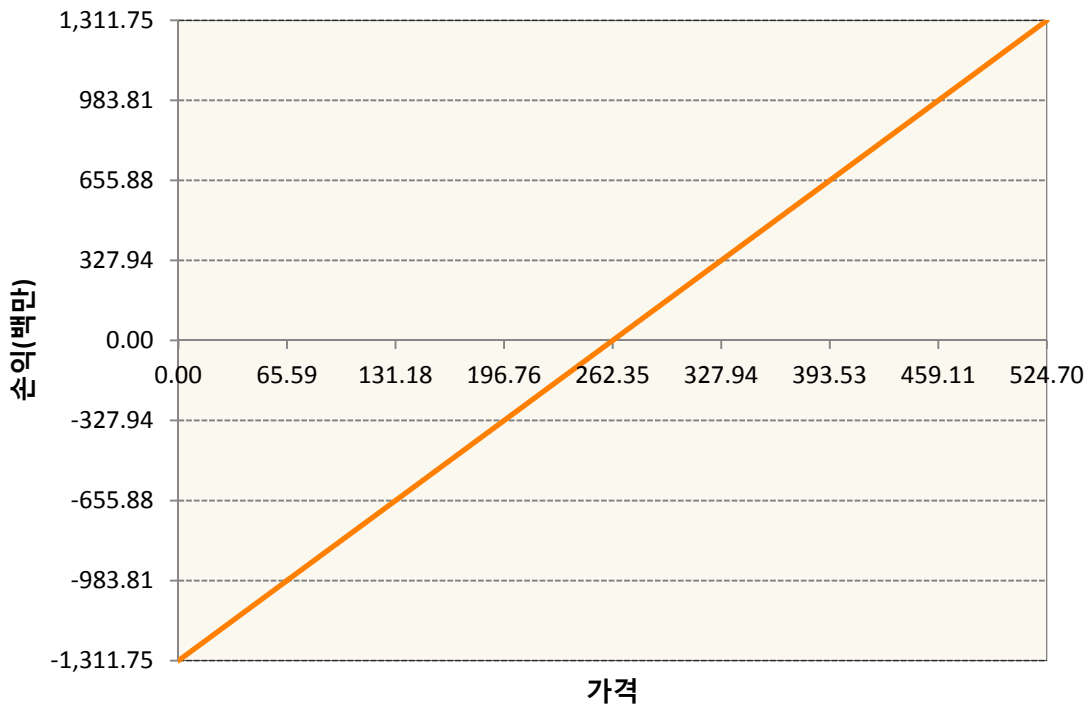
1. 계약금액

(단위:백만원)

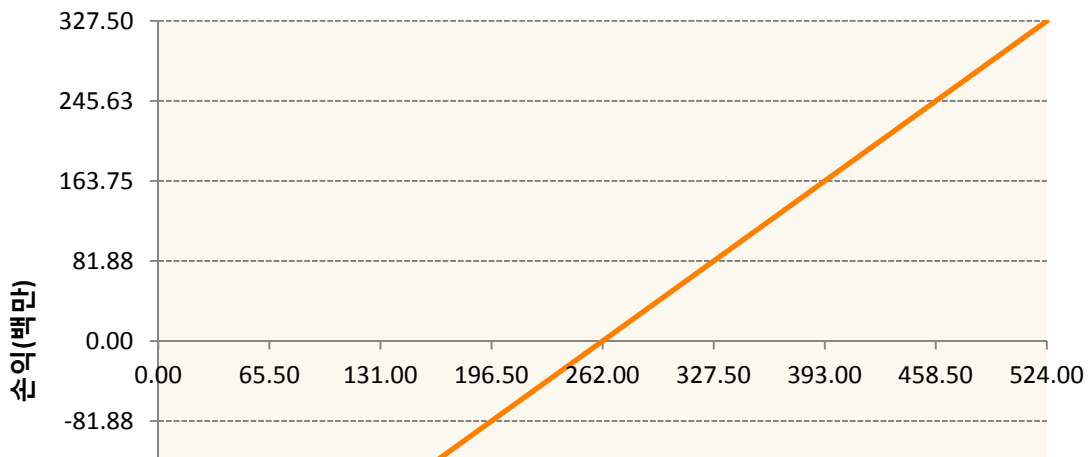
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,639	0	1,639	장내

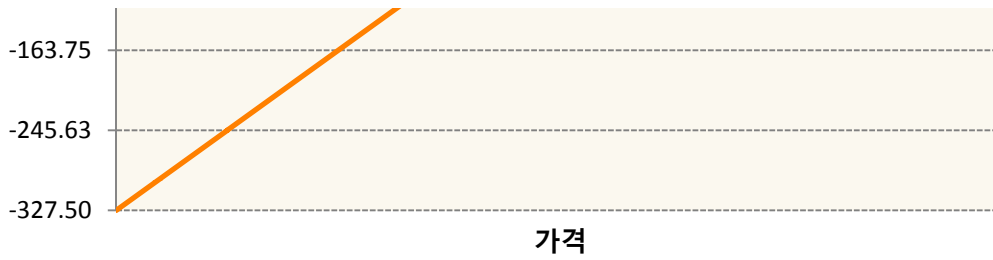
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



KR4101Q60002-2020-06 코스피200지수선물





3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						105
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105	
-5.33%	-70	-70	-70	-70	-70	-70	-70	
-2.67%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	35	35	35	35	35	35	35	
5.33%	70	70	70	70	70	70	70	
8.00%	105	105	105	105	105	105	105	
KR4101Q60002		2020-06 코스피200지수선물						26
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-26	-26	-26	-26	-26	-26	-26	
-5.33%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
-2.67%	-9	-9	-9	-9	-9	-9	-9	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	9	9	9	9	9	9	9	
5.33%	18	18	18	18	18	18	18	
8.00%	26	26	26	26	26	26	26	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

123

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

SMART합성-MSCI선진국증권상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,446	0	14,446	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S200224

1,036

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

671

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	6,551	0	6,551	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(1)	430
SWCSI50000 신한CSI500미래S191210(2)	157

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

912

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

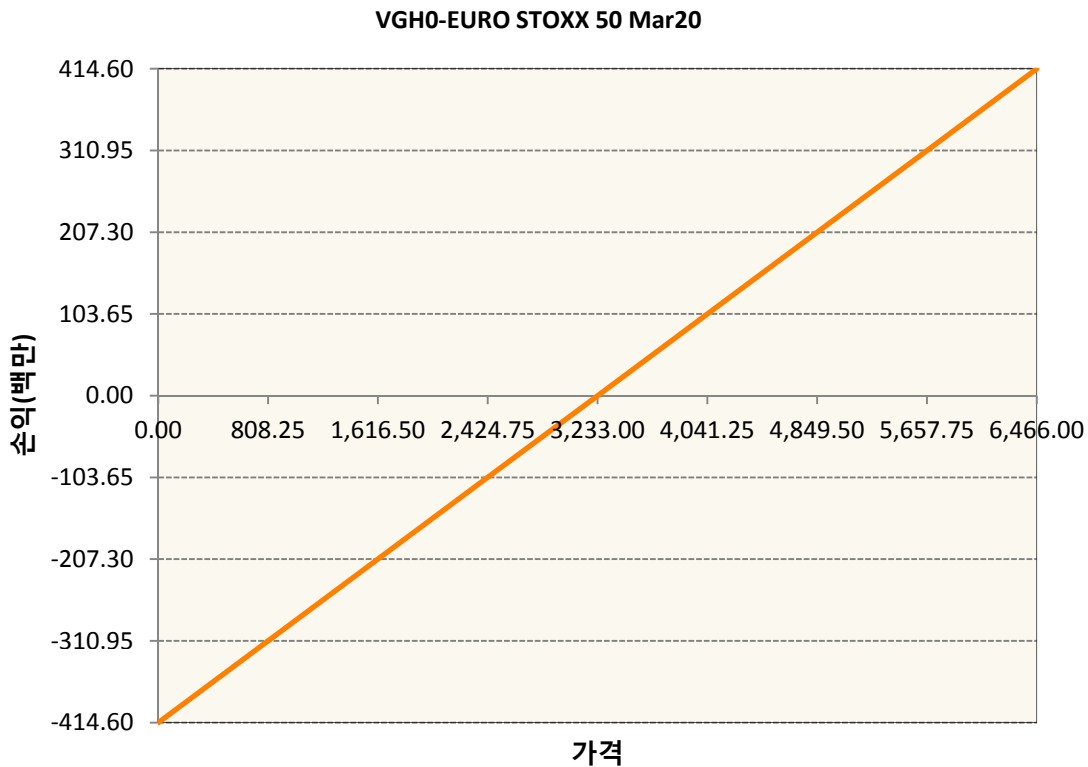
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	415	0	415	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGHO	EURO STOXX 50 Mar20	33
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

26

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

차이나인덱스모(주식-파생형)

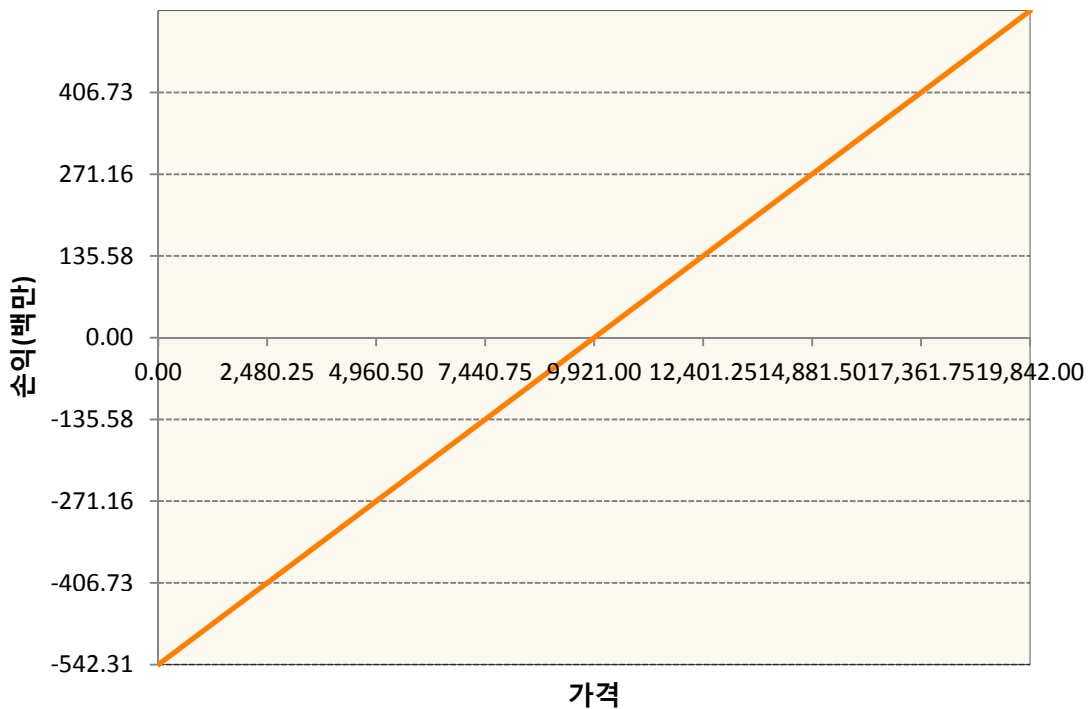
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	542	0	542	장내

2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

HCH0	HSCEI Futures Mar20	43
------	---------------------	----

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

40

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

커버드콜모(주식혼합-파생형)

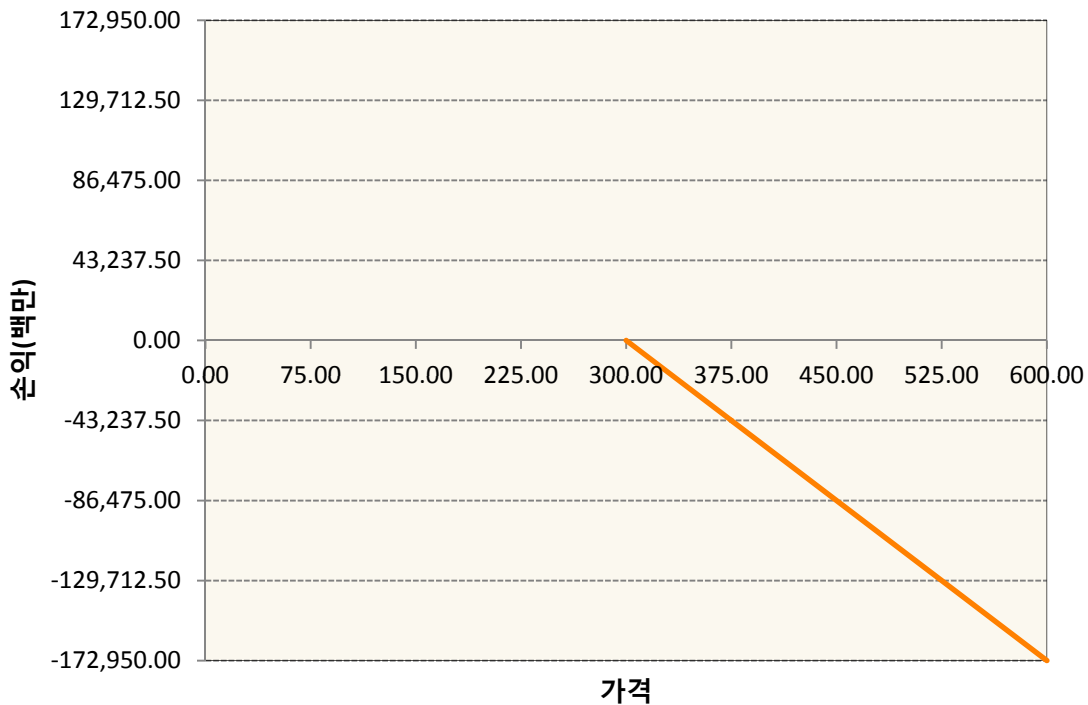
1. 계약금액

(단위:백만원)

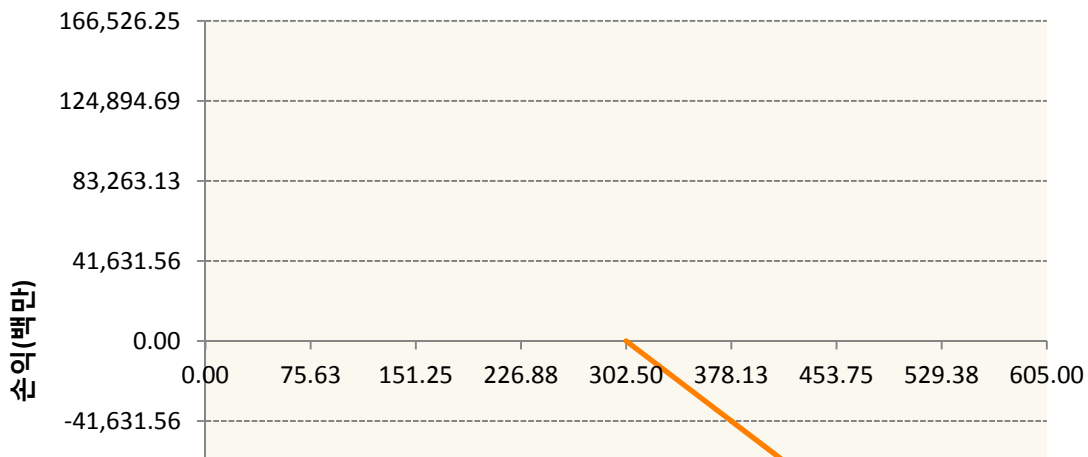
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	448,226	-448,226	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4201Q33007-2020-03 콜300



KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	-1
2.67%	0	0	0	-1	-2	-5	-10
5.33%	0	-2	-4	-10	-20	-35	-56
8.00%	-11	-25	-48	-79	-121	-172	-234
KR4301Q33005 2020-03 풋300							7,629
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,629	-7,629	-7,629	-7,629	-7,629	-7,629	-7,629
-5.33%	-5,086	-5,086	-5,086	-5,086	-5,086	-5,086	-5,086
-2.67%	-2,543	-2,543	-2,543	-2,543	-2,543	-2,543	-2,543
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	2,543	2,543	2,543	2,543	2,542	2,542	2,540
5.33%	5,086	5,085	5,084	5,082	5,078	5,071	5,061
8.00%	7,623	7,615	7,602	7,585	7,561	7,532	7,498

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

7,648

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생형)

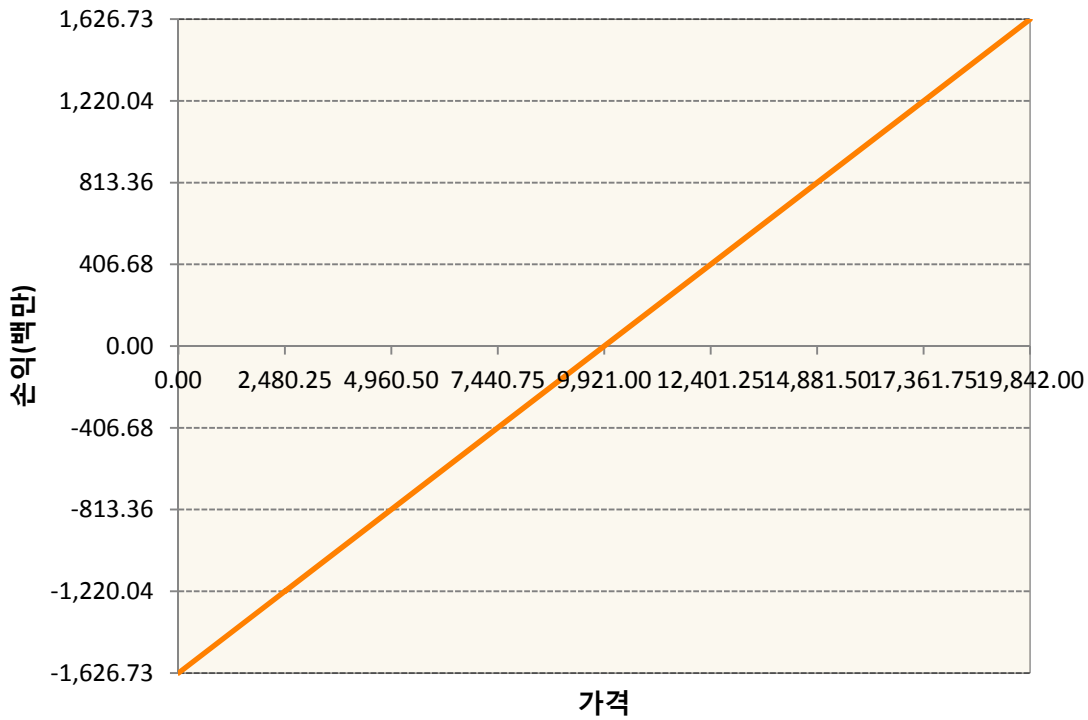
1. 계약금액

(단위:백만원)

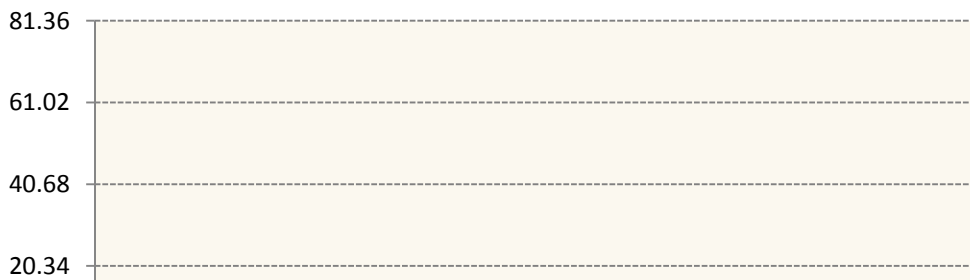
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	1,627	0	1,627	장내
누계	유가증권	옵션	0	4,845	-4,845	장내
누계	통화	선도	0	2,182	-2,182	장외

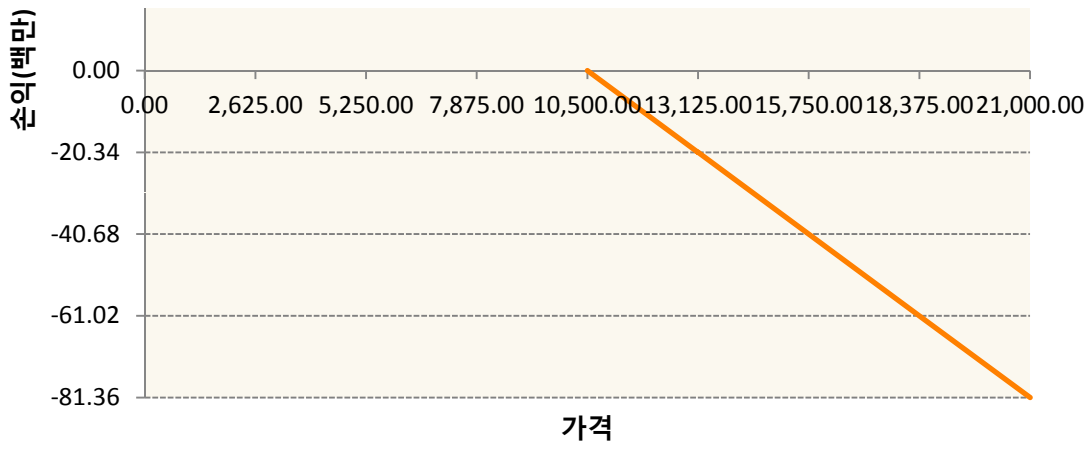
2. 만기시점의 손익구조

HCH0-HSCEI Futures Mar20

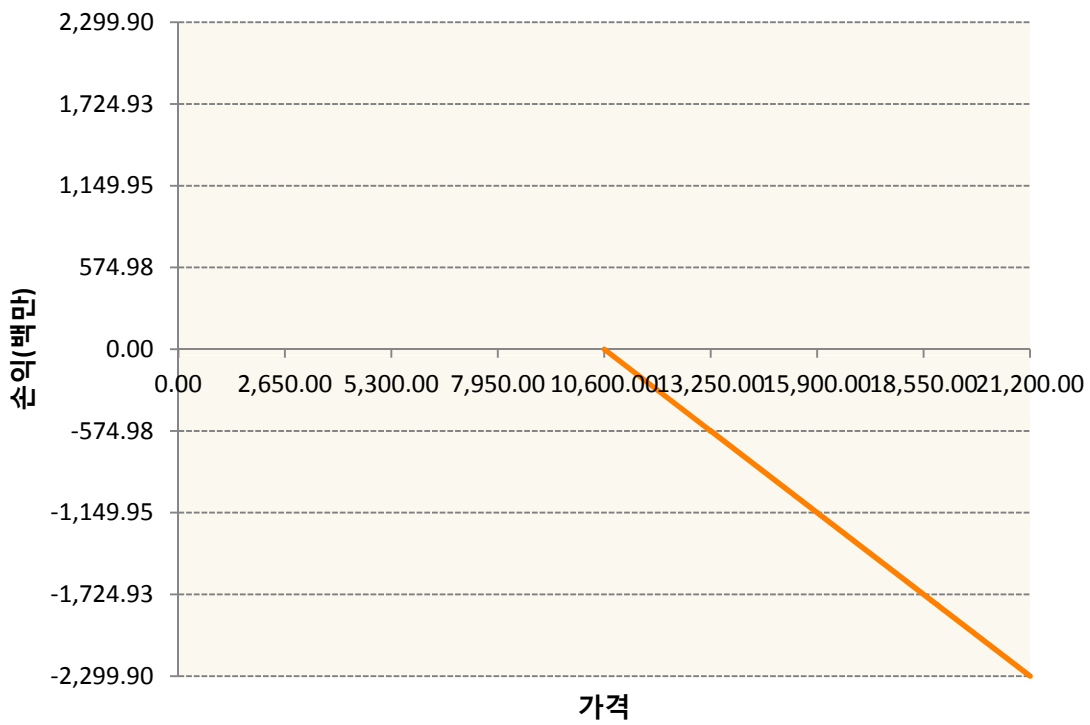


OHHIH0-C105-HSCEI

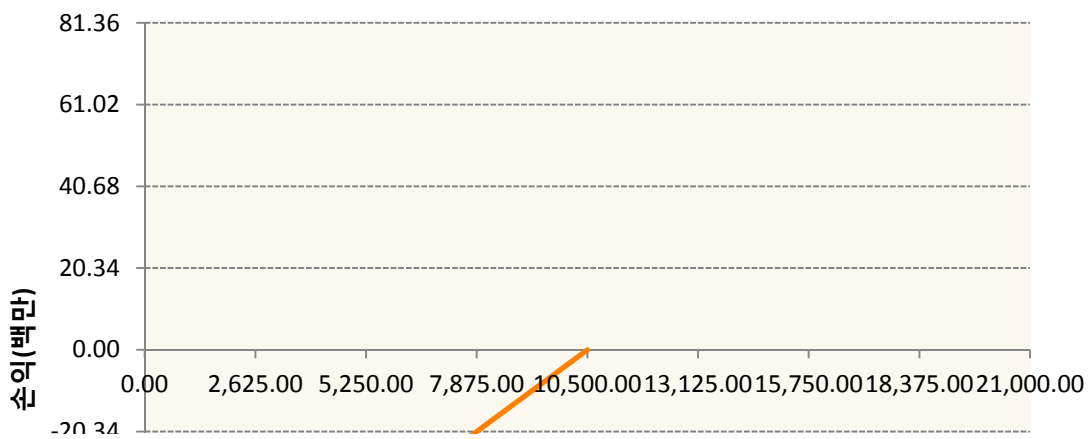


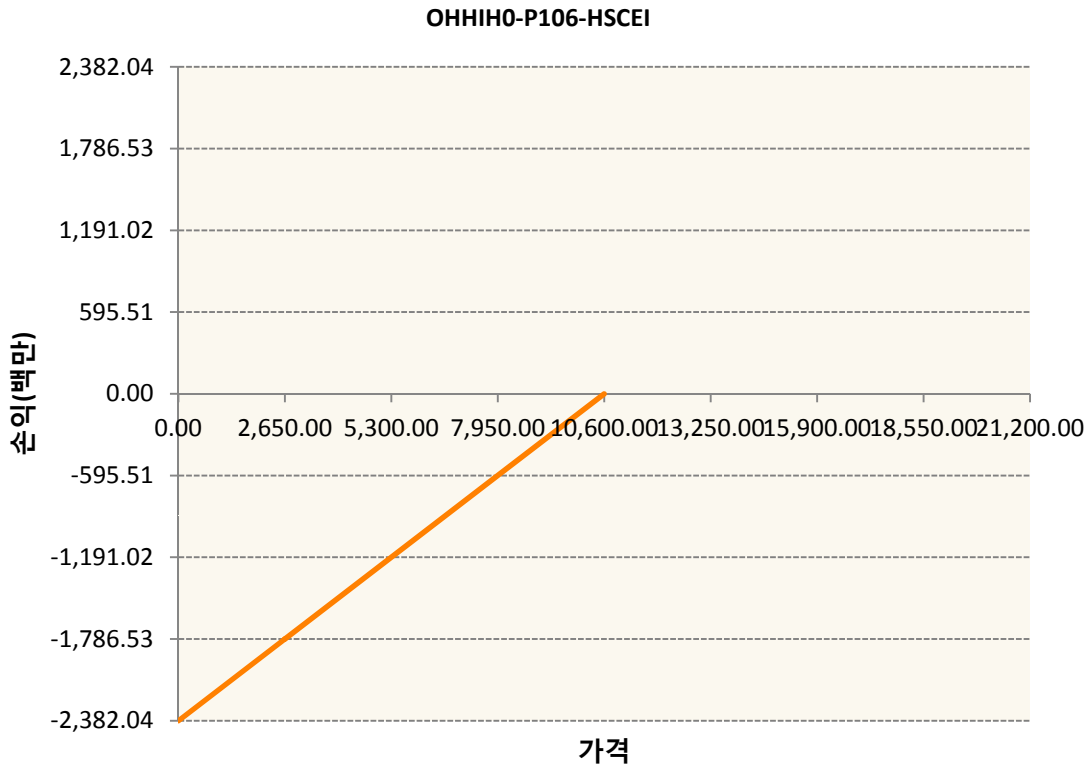
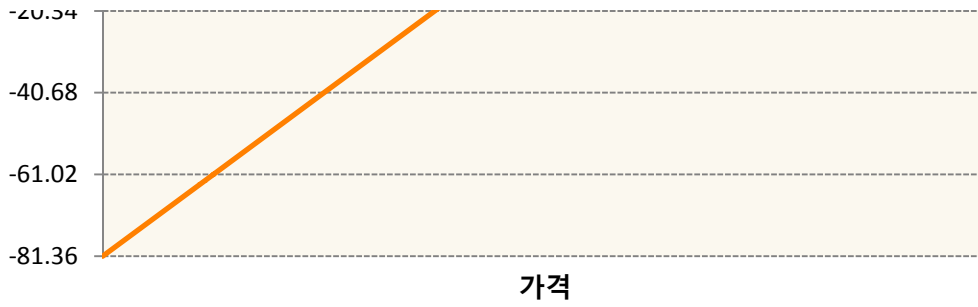


OHHIH0-C106-HSCEI



OHHIH0-P105-HSCEI





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

FX21020G04 KRW/HKD 22-05-20E	175
HCH0 HSCEI Futures Mar20	130
OHHIH0-C1(HSCEI	7
OHHIH0-C1(HSCEI	184
OHHIH0-P1(HSCEI	7
OHHIH0-P1(HSCEI	191

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

532

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼합-파생형)

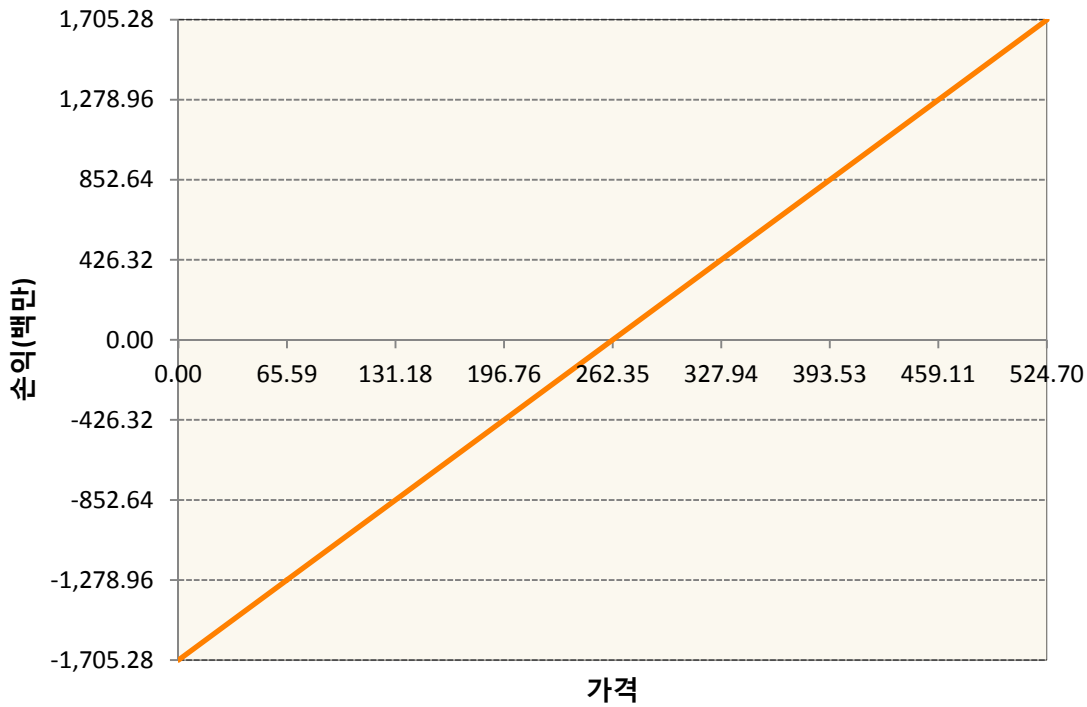
1. 계약금액

(단위:백만원)

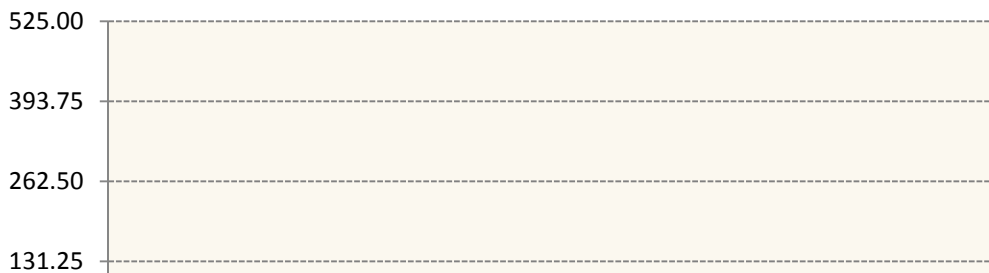
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,705	0	1,705	장내
누계	유가증권	스왑	3,125	0	3,125	장외
누계	유가증권	옵션	0	3,612	-3,612	장내

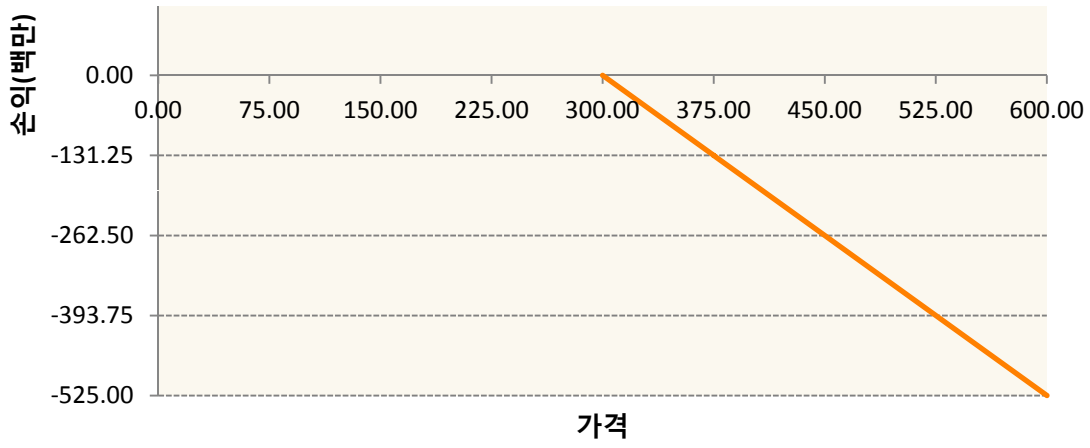
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

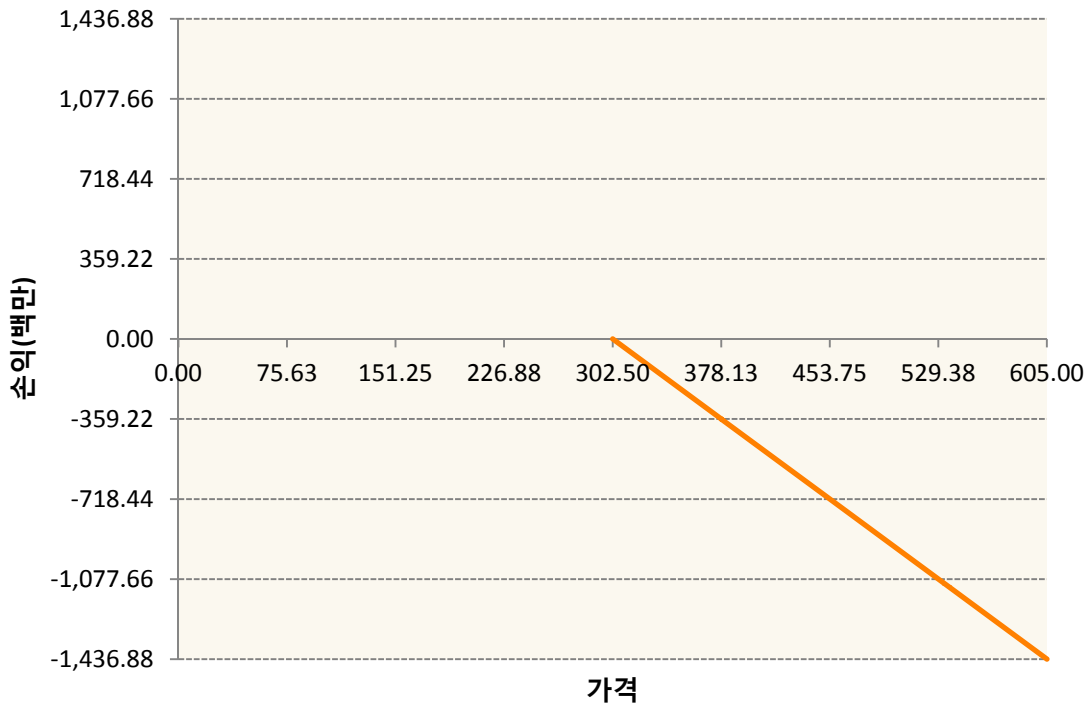


KR4201Q33007-2020-03 콜300

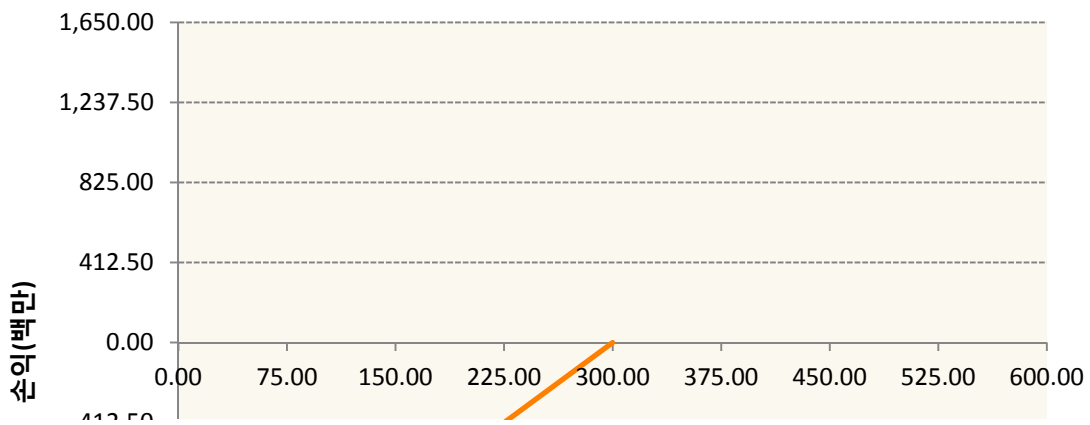




KR4201Q33023-2020-03 콜302.5



KR4301Q33005-2020-03 풋300





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11		UBCSFXC1 INDEX_16						269
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-269	-269	-269	-269	-269	-269	-269	
-5.33%	-179	-179	-179	-179	-179	-179	-179	
-2.67%	-90	-90	-90	-90	-90	-90	-90	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	90	90	90	90	90	90	90	
5.33%	179	179	179	179	179	179	179	
8.00%	269	269	269	269	269	269	269	
KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						137
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-137	-137	-137	-137	-137	-137	-137	
-5.33%	-91	-91	-91	-91	-91	-91	-91	
-2.67%	-46	-46	-46	-46	-46	-46	-46	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	46	46	46	46	46	46	46	
5.33%	91	91	91	91	91	91	91	
8.00%	137	137	137	137	137	137	137	
KR4201Q33007		2020-03 콜300						1
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	0	0	0	0	0	0	0	
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	0	0	0	0	0	0	0	
5.33%	0	0	0	0	0	0	0	
8.00%	0	0	0	0	-1	-1	-1	
KR4201Q33023		2020-03 콜302.5						2
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	

-8.00%	0	0	0	0	0	0	0
-5.33%	0	0	0	0	0	0	0
-2.67%	0	0	0	0	0	0	0
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	0	0	0	0	0	0	0
5.33%	0	0	0	0	0	0	0
8.00%	0	0	0	-1	-1	-1	-2
KR4301Q33005 2020-03 풋300							116
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-116	-116	-116	-116	-116	-116	-116
-5.33%	-77	-77	-77	-77	-77	-77	-77
-2.67%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	39	39	39	39	39	39	39
5.33%	77	77	77	77	77	77	77
8.00%	116	116	115	115	115	114	114

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

513

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

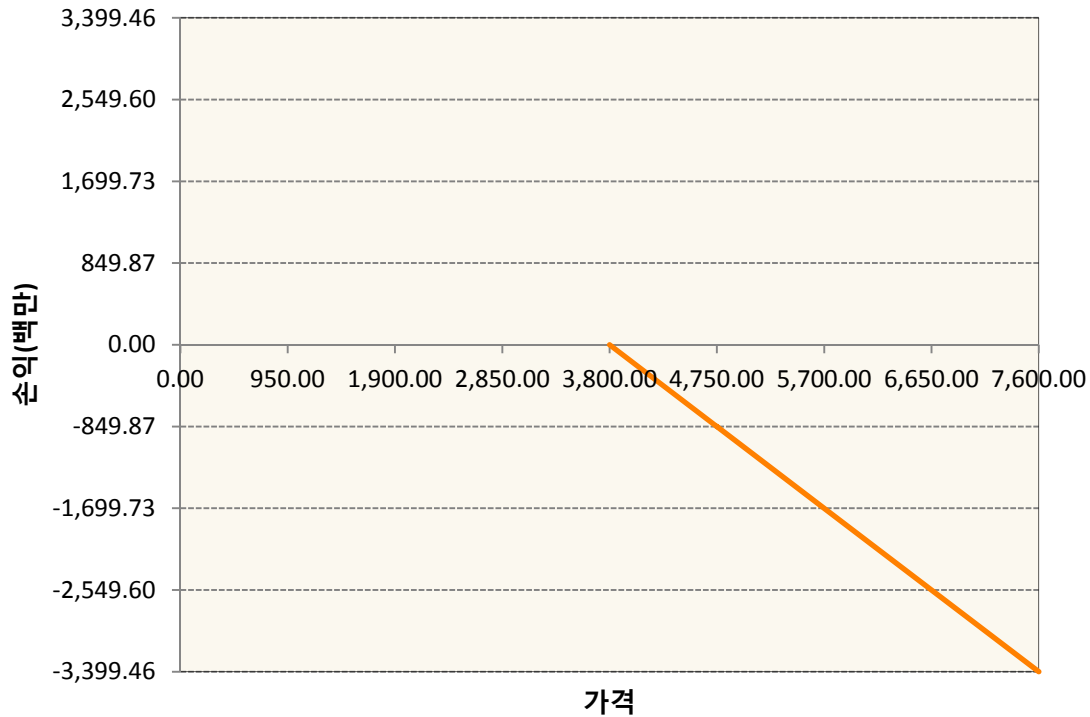
1. 계약금액

(단위:백만원)

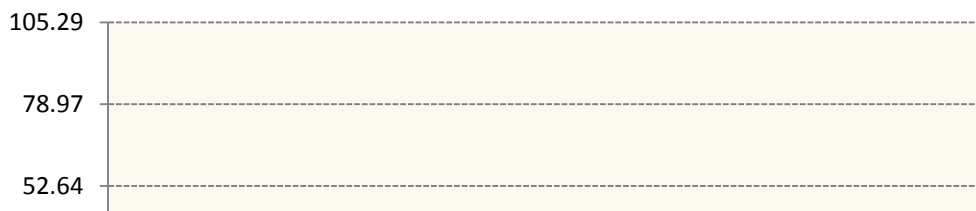
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	340	0	340	
누계	유가증권	스왑	11,104	0	11,104	장외
누계	유가증권	옵션	0	7,009	-7,009	장내
누계	통화	선도	551	3,612	-3,061	장외

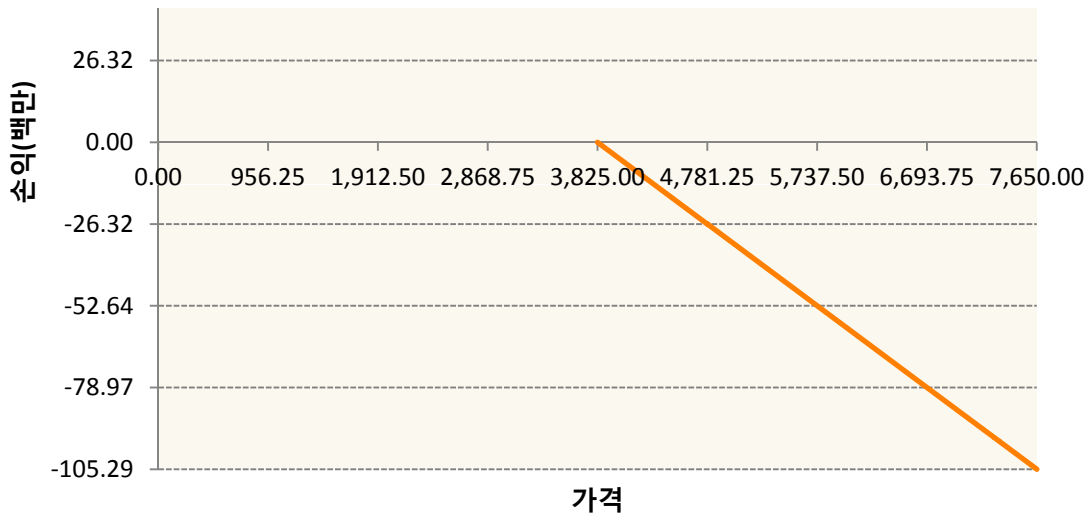
2. 만기시점의 손익구조

OESXH0-C3800-EURO STOXX 50

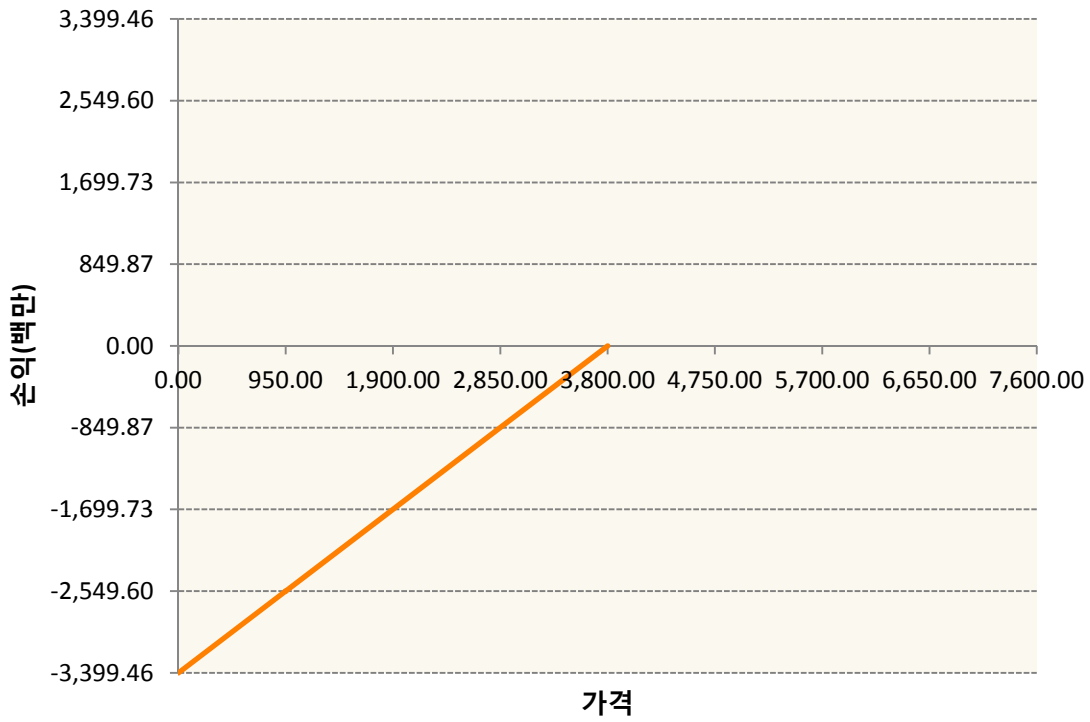


OESXH0-C3825-EURO STOXX 50

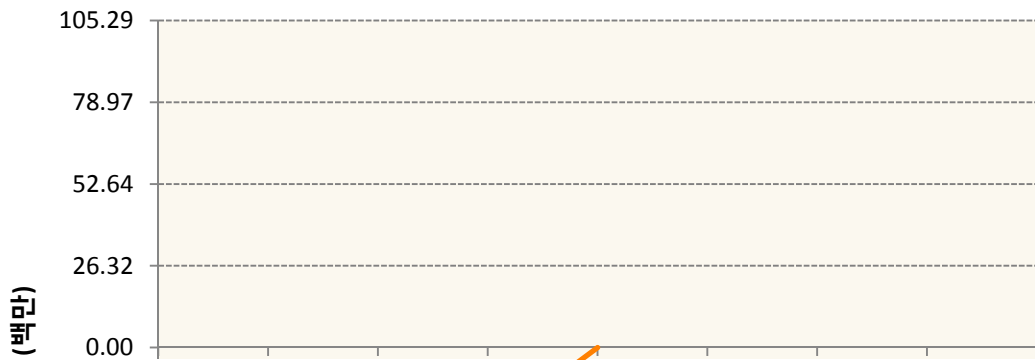


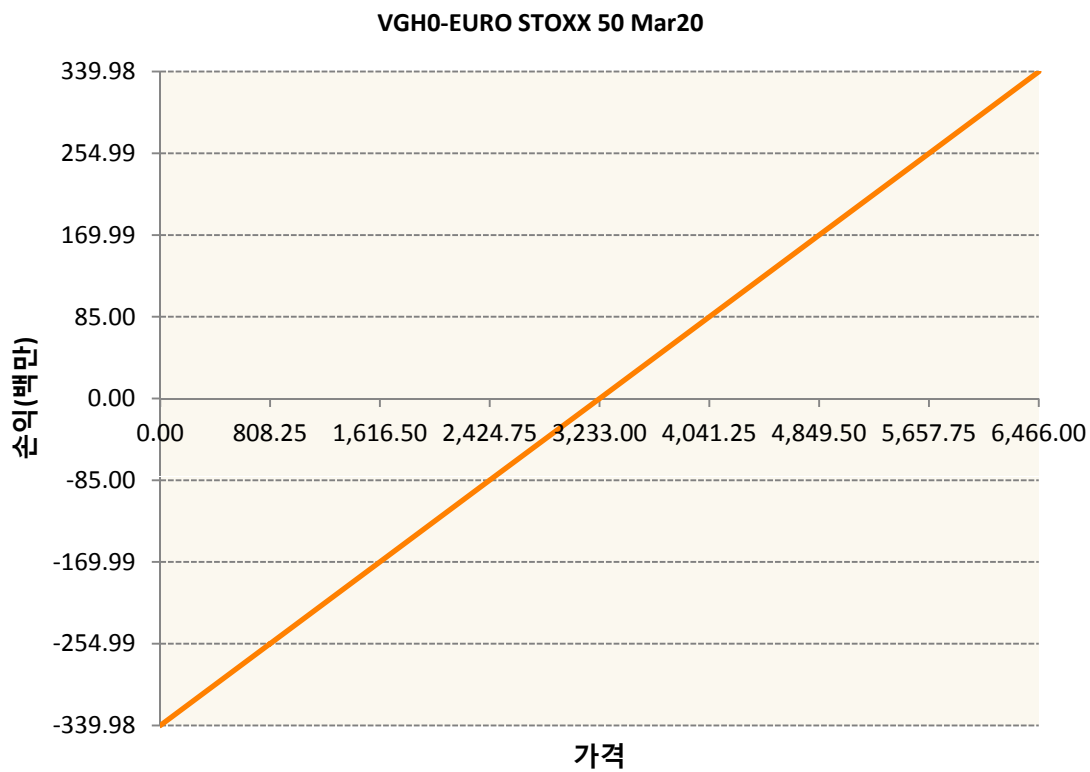
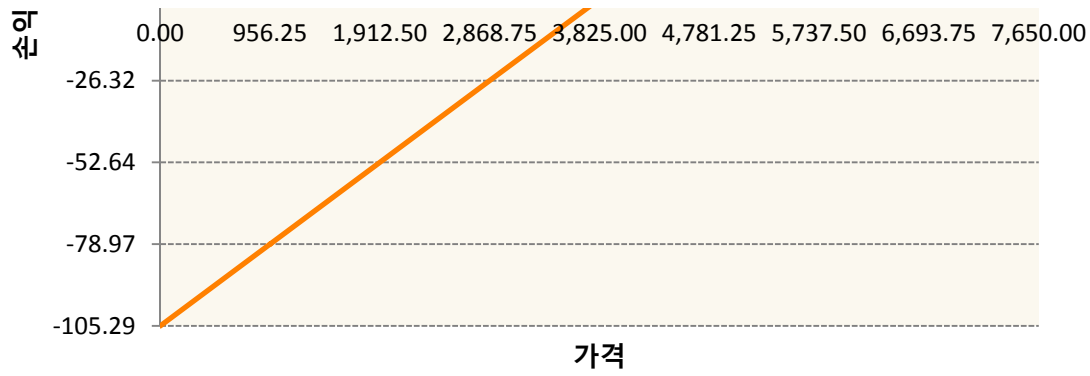


OESXH0-P3800-EURO STOXX 50



OESXH0-P3825-EURO STOXX 50





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SQP>SG EURO Covered CALL STRATEGY		111
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E		289
FX21020H00 EUR/KRW 27-03-20E		44
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		272
OESXH0-C3& EURO STOXX 50		8
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		272
OESXH0-P3& EURO STOXX 50		8
VGHO EURO STOXX 50 Mar20		27

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

770

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

952

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

84

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

123

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

스마트KRX300인덱스목표전환형1호

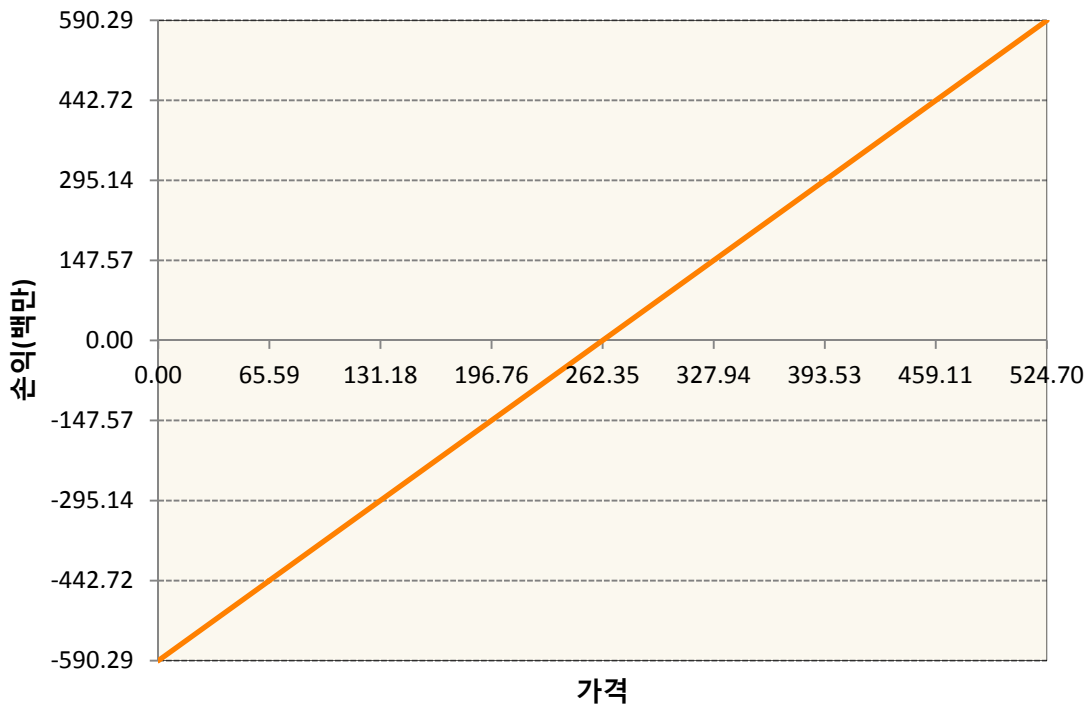
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	590	0	590	장내

2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						47
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47	
-5.33%	-32	-32	-32	-32	-32	-32	-32	
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	16	16	16	16	16	16	16	
5.33%	32	32	32	32	32	32	32	
8.00%	47	47	47	47	47	47	47	

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

44

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

리디파인K200(주식혼합-파생재간접형)

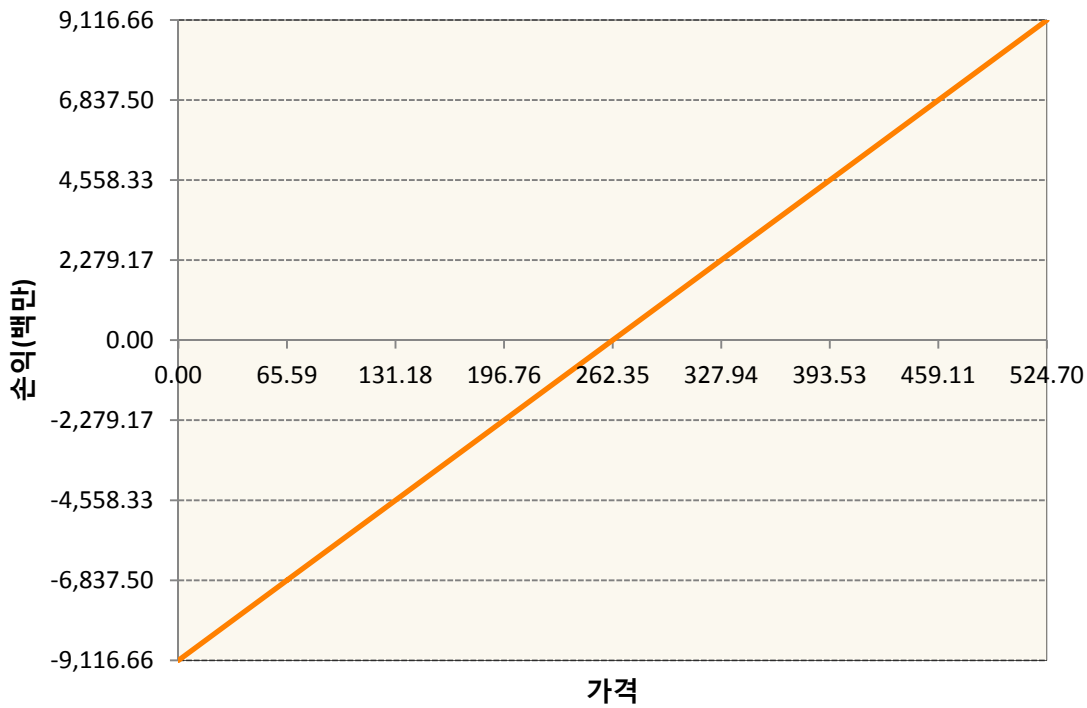
1. 계약금액

(단위:백만원)

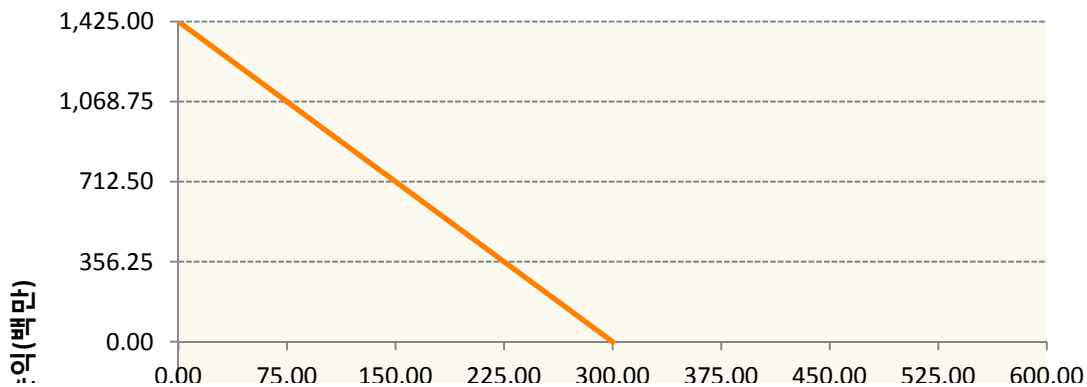
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	9,117	0	9,117	장내
누계	유가증권	옵션	2,257	0	2,257	장내

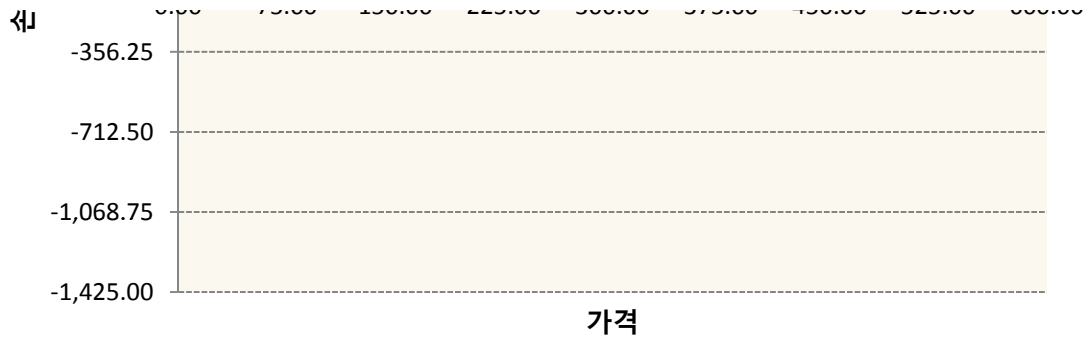
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

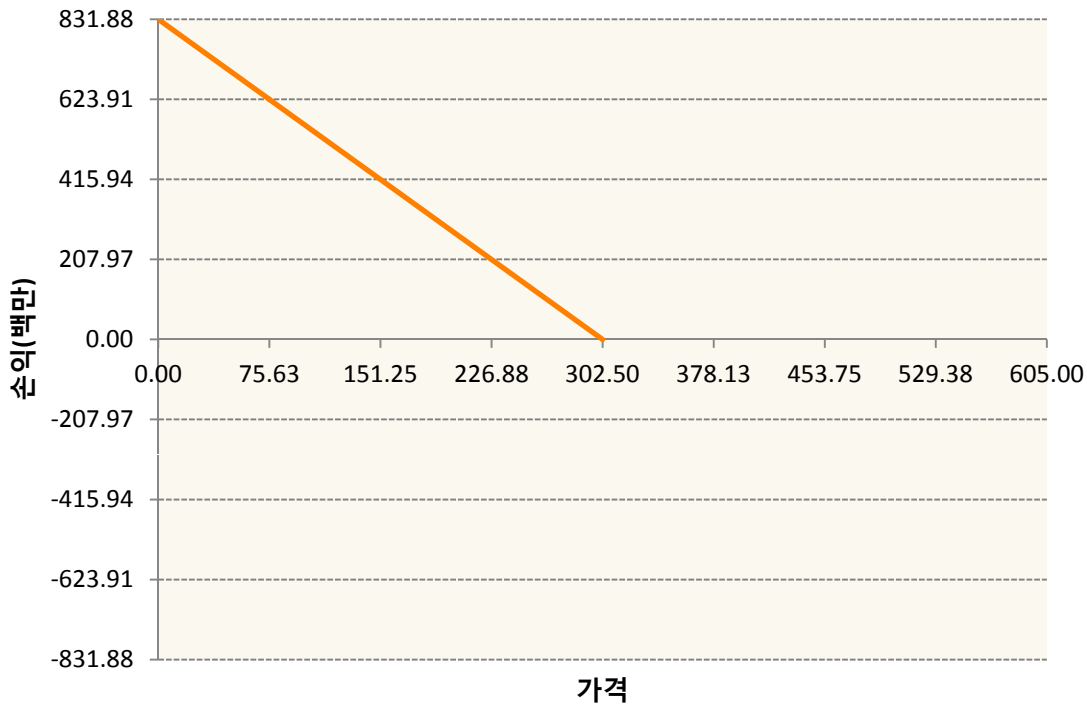


KR4301Q33005-2020-03 풋300





KR4301Q33021-2020-03 풋302.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						731
	기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	-731	-731	-731	-731	-731	-731	-731	
-5.33%	-488	-488	-488	-488	-488	-488	-488	
-2.67%	-244	-244	-244	-244	-244	-244	-244	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	244	244	244	244	244	244	244	
5.33%	488	488	488	488	488	488	488	
8.00%	731	731	731	731	731	731	731	
KR4301Q33005		2020-03 풋300						100
	기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	100	100	100	100	100	100	100
-5.33%	67	67	67	67	67	67	67
-2.67%	33	33	33	33	33	33	33
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-33	-33	-33	-33	-33	-33	-33
5.33%	-67	-67	-67	-67	-67	-66	-66
8.00%	-100	-100	-100	-99	-99	-99	-98

KR4301Q33021 2020-03 풋302.5 58

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	58	58	58	58	58	58	58
-5.33%	39	39	39	39	39	39	39
-2.67%	19	19	19	19	19	19	19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-38
8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-57	-57

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

844

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

H2O글로벌본드(USD)(채권혼합-파

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	206,543	0	206,543	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

H2O글로벌본드(UH)(채권혼합-파)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
누계	유가증권	수익증권	109,516	0	109,516	

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

H2O글로벌본드(H)(채권혼합-파생)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	0	0	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	518,975	0	518,975	
누계	통화	선도	18,063	524,309	-506,246	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,551
FX21020F02 KRW/USD 23-03-20E	1,445
FX21020F03 KRW/USD 31-03-20E	3,083
FX21020F04 KRW/USD 31-03-20E	2,890
FX21020G00 KRW/USD 06-04-20E	2,601
FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	963
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,195
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	1,223
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	963
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	1,927
FX21020G02 KRW/USD 18-03-20E	3,314
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	3,314
FX21020G03 KRW/USD 21-04-20E	1,927
FX21020G04 KRW/USD 24-04-20E	3,853
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	2,254
FX21020G04 KRW/USD 27-04-20E	1,927
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	193
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	4,913
FX21020G06 USD/KRW 31-03-20E	482
FX21020H00 USD/KRW 31-03-20E	963
FX21020H01 KRW/USD 11-05-20E	2,408
IE00BD8RGM75	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음
IE00BHNZKL13	* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

15,396

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

127

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

커버드콜마일드모(주식혼합-파생)

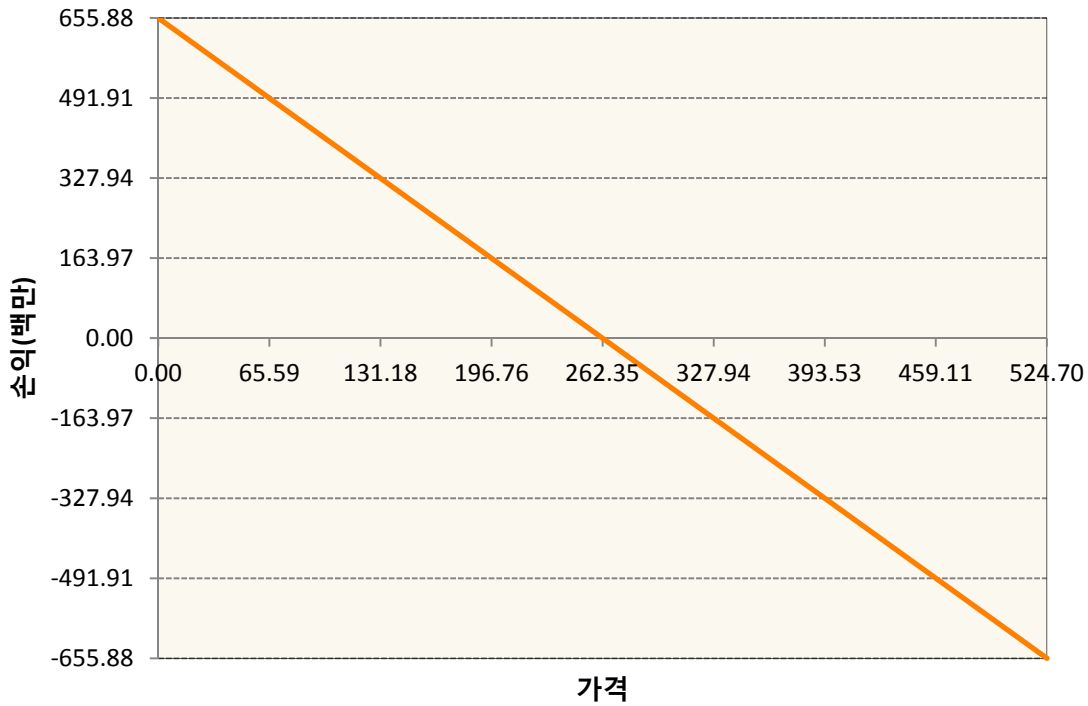
1. 계약금액

(단위:백만원)

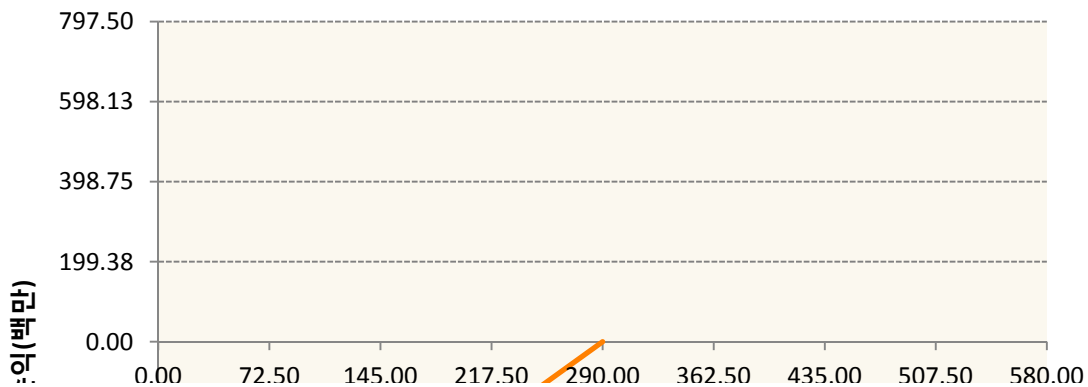
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	656	-656	장내
누계	유가증권	옵션	0	3,503	-3,503	장내

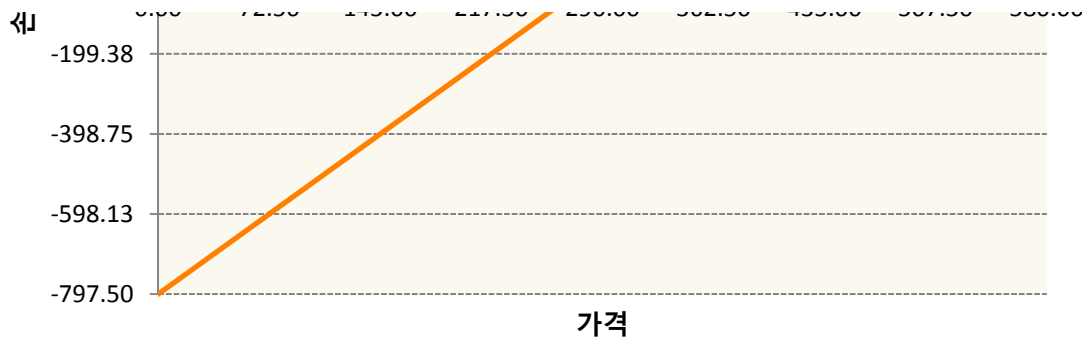
2. 만기시점의 손익구조

KR4101Q30005-2020-03 코스피200지수선물

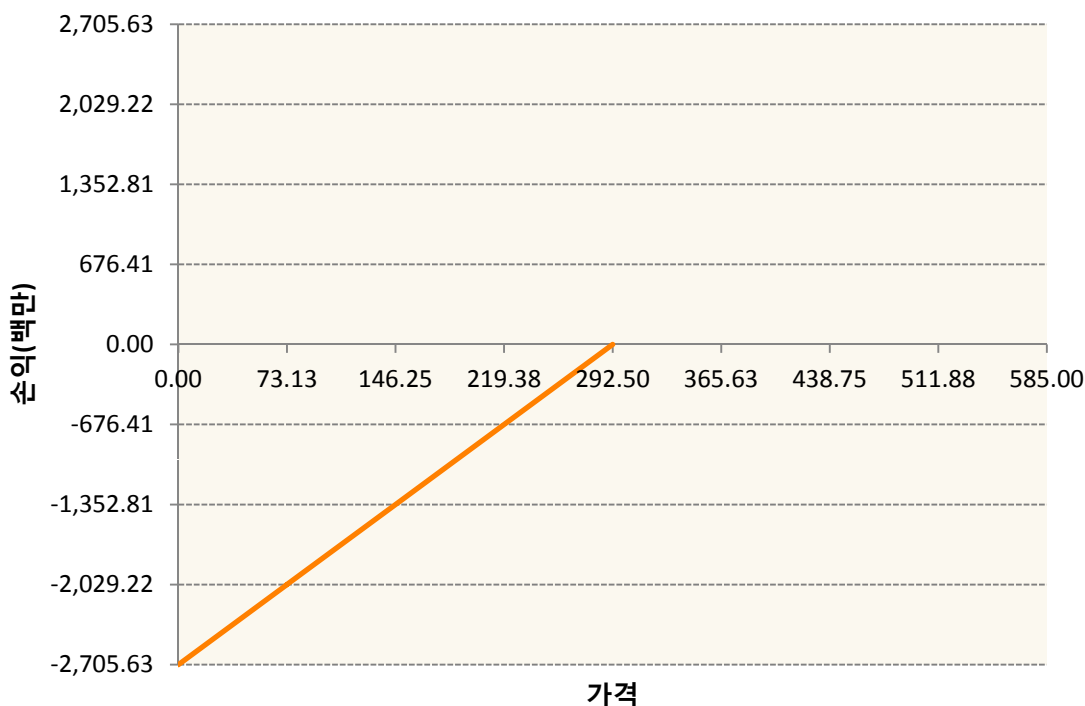


KR4301Q32908-2020-03 풋290





KR4301Q32924-2020-03 풋292.5



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

KR4101Q30005		2020-03 코스피200지수선물						53
기초자산의 변동성								
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%	
-8.00%	53	53	53	53	53	53	53	
-5.33%	35	35	35	35	35	35	35	
-2.67%	18	18	18	18	18	18	18	
0%	0	0	0	0	0	0	0	
2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18	
5.33%	-35	-35	-35	-35	-35	-35	-35	
8.00%	-53	-53	-53	-53	-53	-53	-53	
KR4301Q32908		2020-03 풋290						58
기초자산의 변동성								

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-58	-58	-58	-58	-58	-58	-58
-5.33%	-39	-39	-39	-39	-39	-39	-39
-2.67%	-19	-19	-19	-19	-19	-19	-19
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	19	19	19	19	19	19	19
5.33%	38	38	38	38	38	37	37
8.00%	56	56	55	54	54	53	52
KR4301Q32924 2020-03 풋292.5							195
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-195	-195	-195	-195	-195	-195	-195
-5.33%	-130	-130	-130	-130	-130	-130	-130
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	64
5.33%	130	129	129	129	128	127	126
8.00%	192	191	189	188	186	184	182

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

302

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

H2O트리오(H)(채권혼합-파생재간접형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	수익증권	0	179	-179	
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	수익증권	8,809	0	8,809	
누계	통화	선도	5,672	14,559	-8,887	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

FX21020G00 KRW/USD 12-03-20E	328
FX21020G01 KRW/USD 12-03-20E	91
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	182
FX21020G05 KRW/USD 31-03-20E	215
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	13
FX21020H00 USD/KRW 12-03-20E	39
FX21020H01 USD/KRW 31-03-20E	49
FX21020H02 USD/KRW 12-03-20E	354
FX21020H02 KRW/USD 13-04-20E	350
IE00BD8RGM75	

* 해당종목은 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

574

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

스마트베트남VN30인덱스(주식혼합)

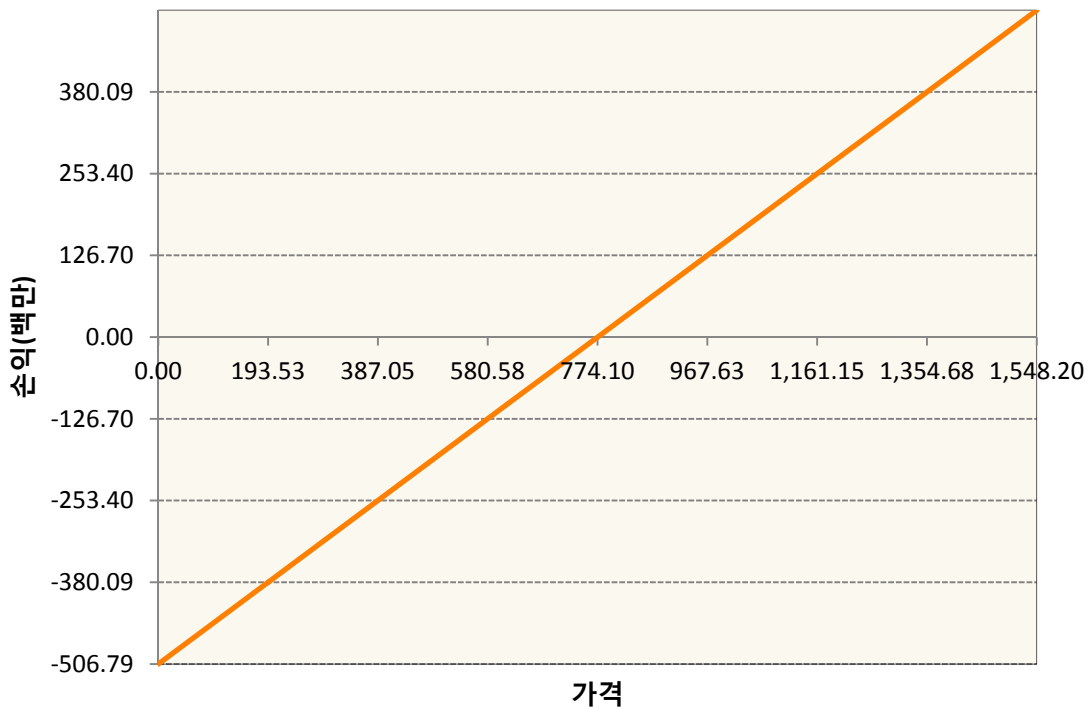
1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	507	0	507	
누계	유가증권	스왑	1,135	0	1,135	장외
누계	통화	선도	151	757	-606	장외

2. 만기시점의 손익구조

VNCH0-VN30 Index Future Mar20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

2.55E+11 VN30TR Index(EUR)	91
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21019Z04 KRW/EUR 27-03-20E	3
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F00 KRW/EUR 27-03-20E	7

FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F01: KRW/EUR 27-03-20E	7
FX21020F03: KRW/EUR 24-04-20E	7
FX21020F04: EUR/KRW 24-04-20E	2
FX21020G00 EUR/KRW 27-03-20E	10
FX21020G01 KRW/EUR 22-05-20E	6
FX21020G05 KRW/EUR 26-06-20E	12
VNCH0 VN30 Index Future Mar20	41

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

127

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

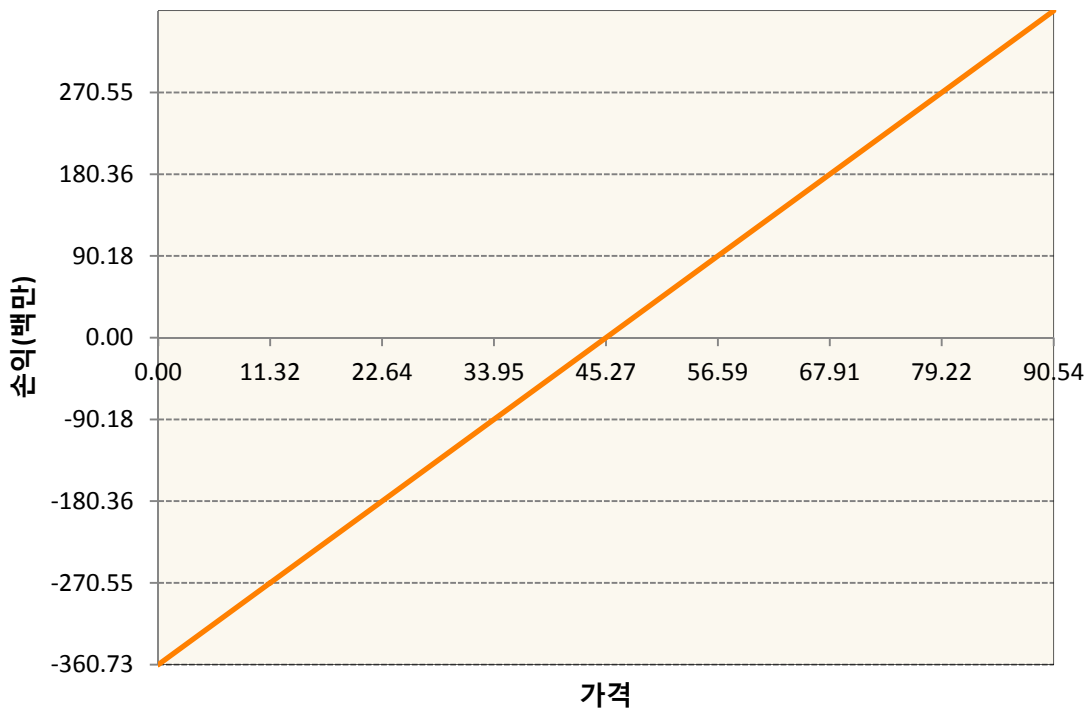
1. 계약금액

(단위:백만원)

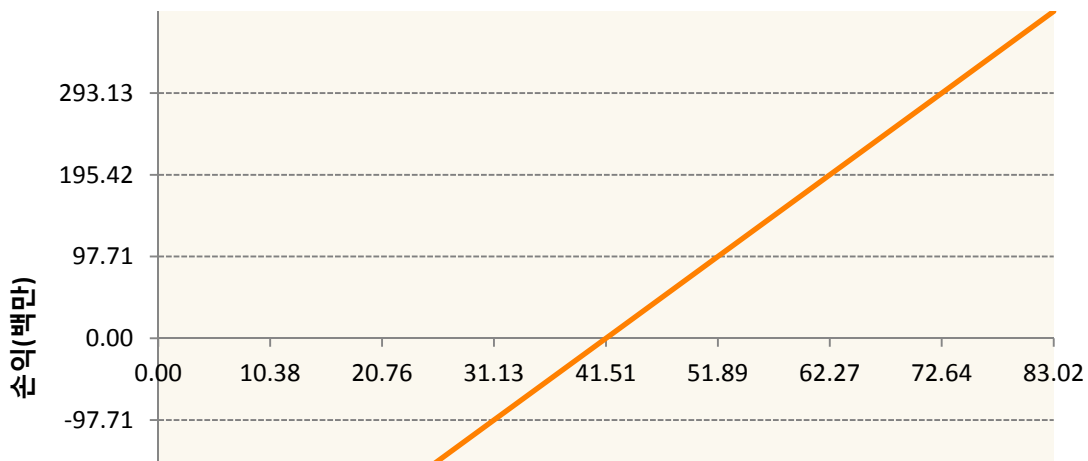
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	1,750	120	1,629	

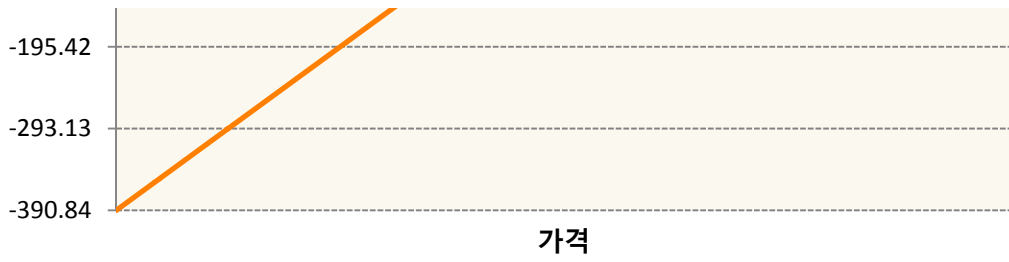
2. 만기시점의 손익구조

COK0-BRENT CRUDE FUTR May20

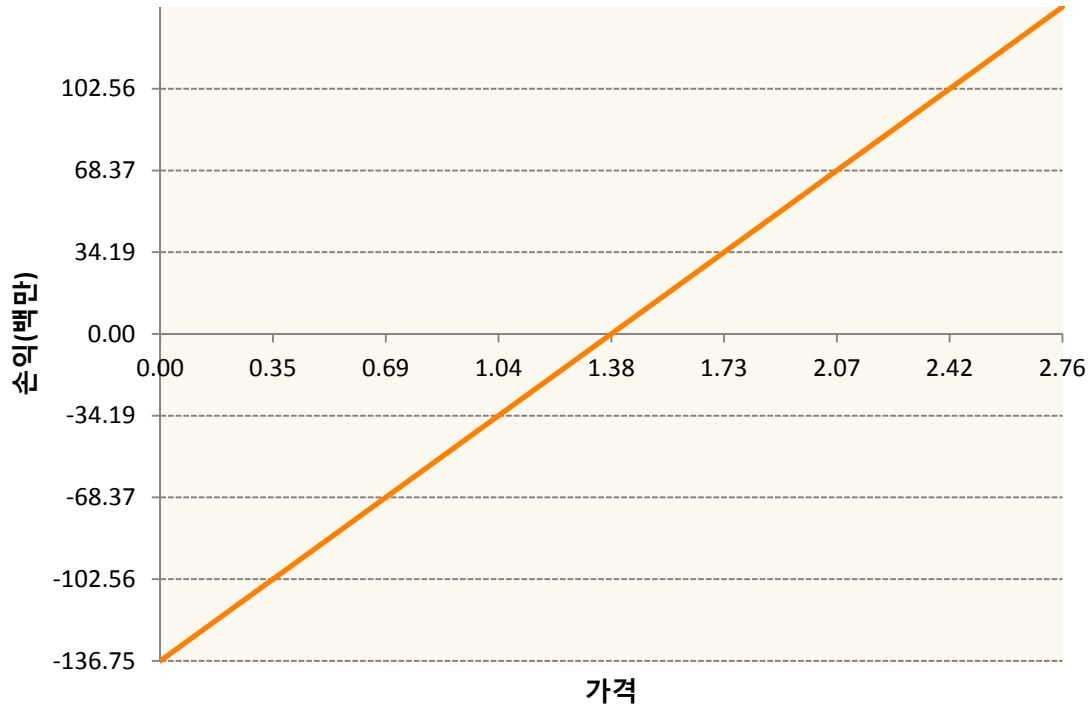


CLK0-WTI CRUDE FUTURE May20

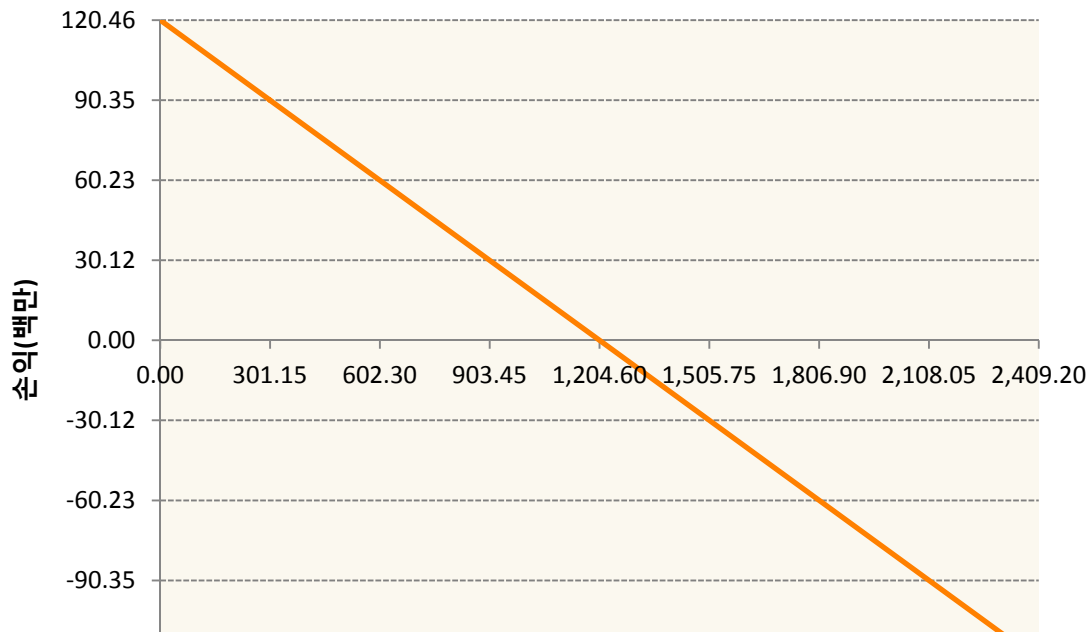


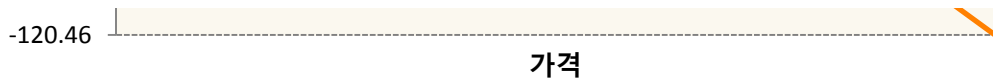


HOK0-NY Harb ULSD Fut May20

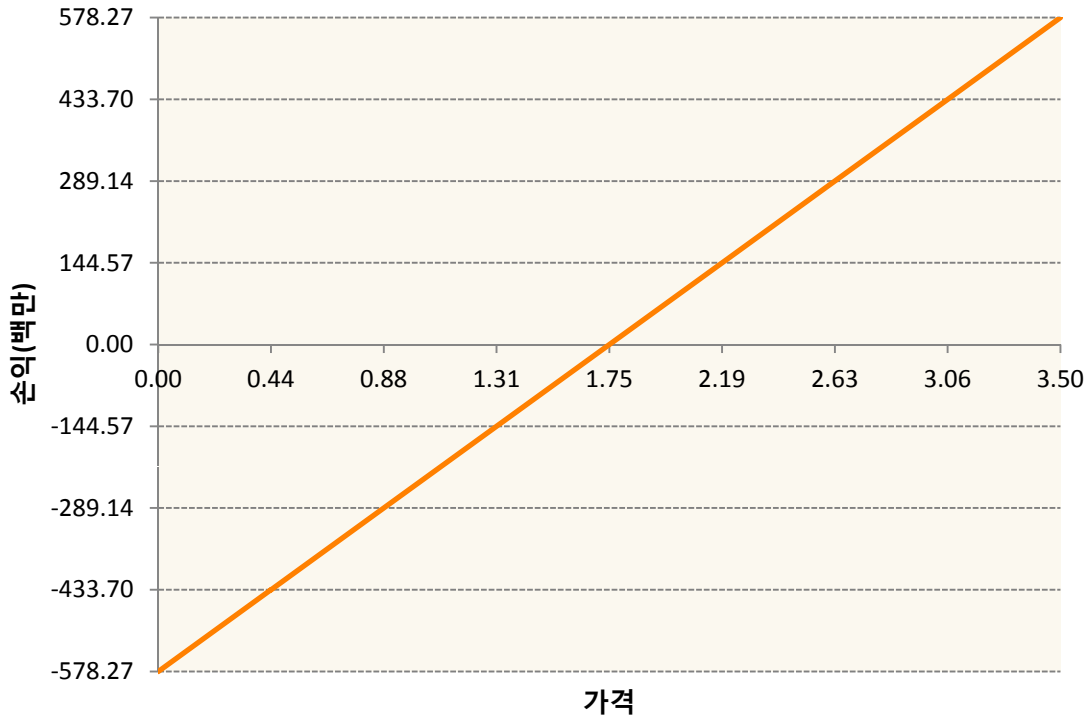


KR4175Q30009-2020-03 달러선물

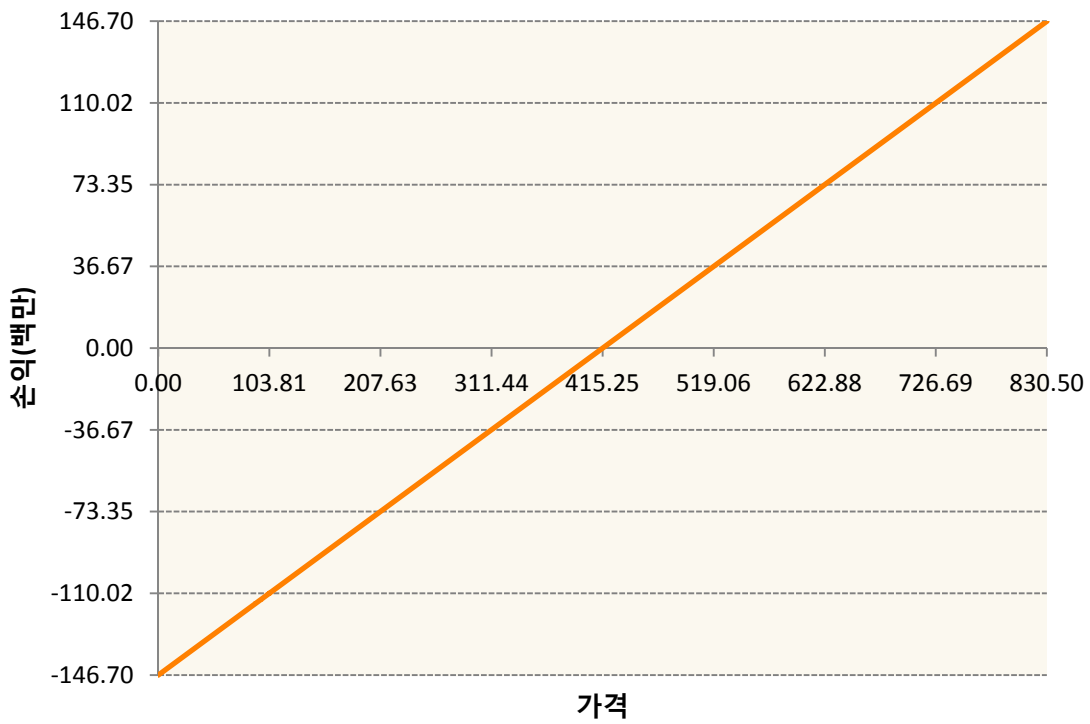




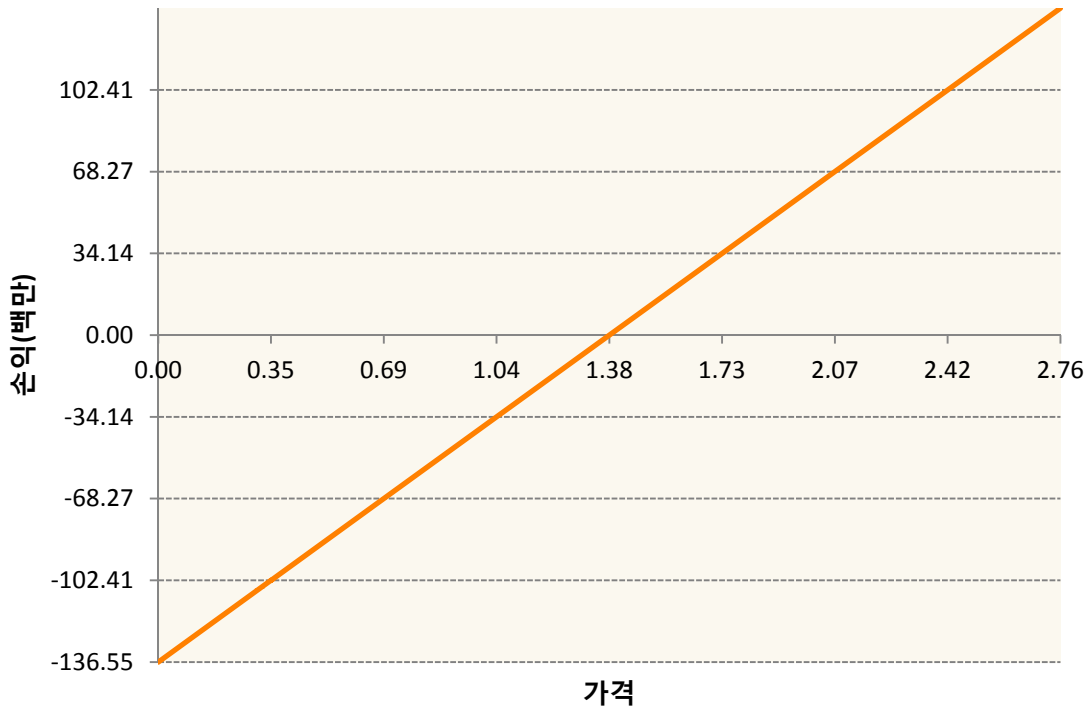
NGK20-NATURAL GAS FUTR May20



QSK0-Low Su Gasoil G Mar20



XBK0-GASOLINE RBOB FUT May20



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

C0K0	BRENT CRUDE FUTR May20	29
CLK0	WTI CRUDE FUTURE May20	31
HOK0	NY Harb ULSD Fut May20	11
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	10
NGK20	NATURAL GAS FUTR May20	46
QSK0	Low Su Gasoil G Mar20	12
XBK0	GASOLINE RBOB FUT May20	11

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

296

공시일	2020-03-10
기준일	2020-03-09

애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

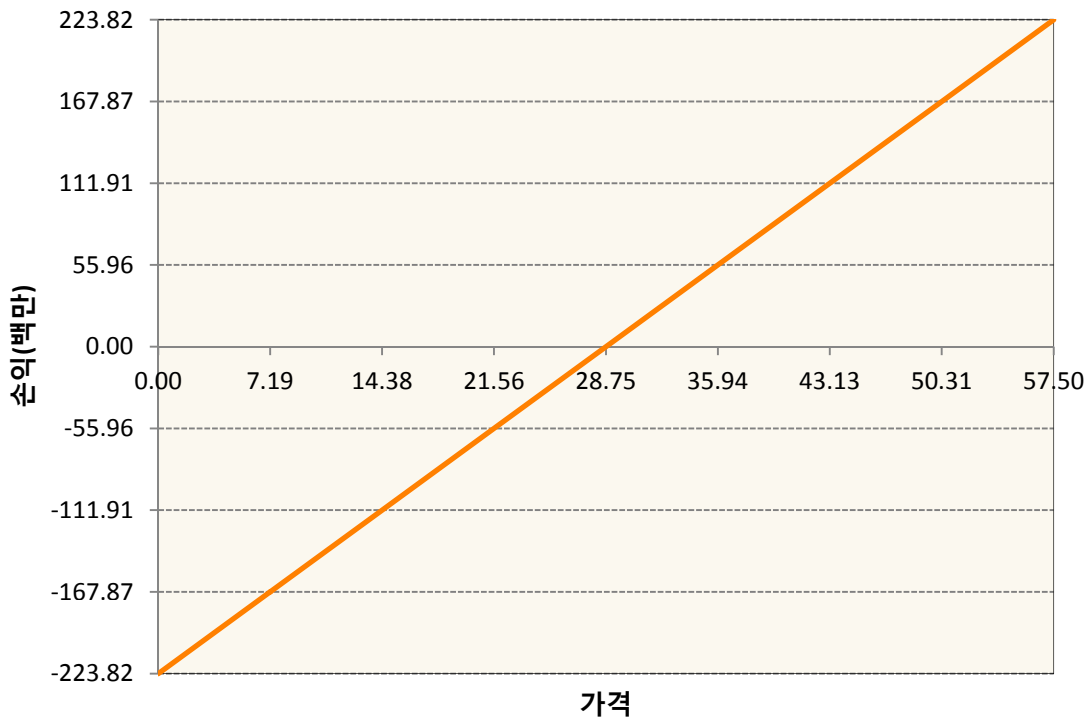
1. 계약금액

(단위:백만원)

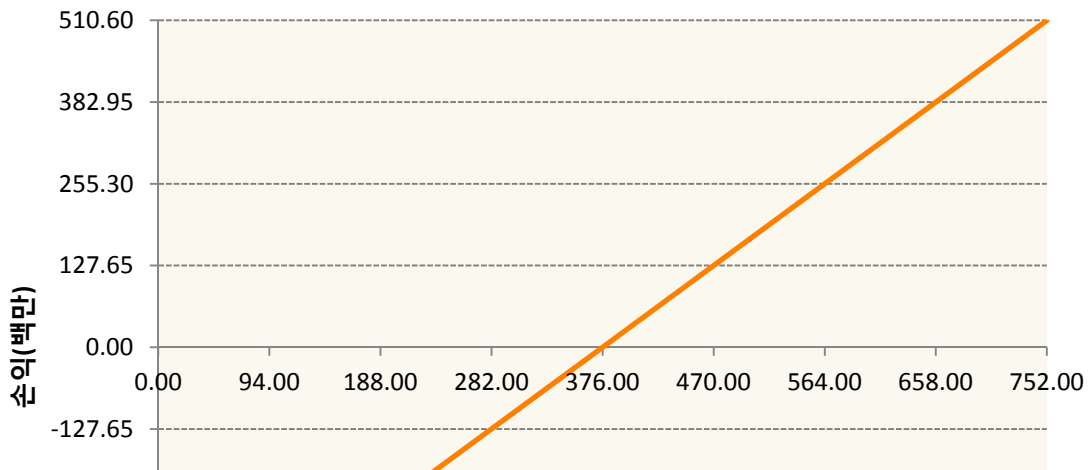
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	2,545	157	2,389	

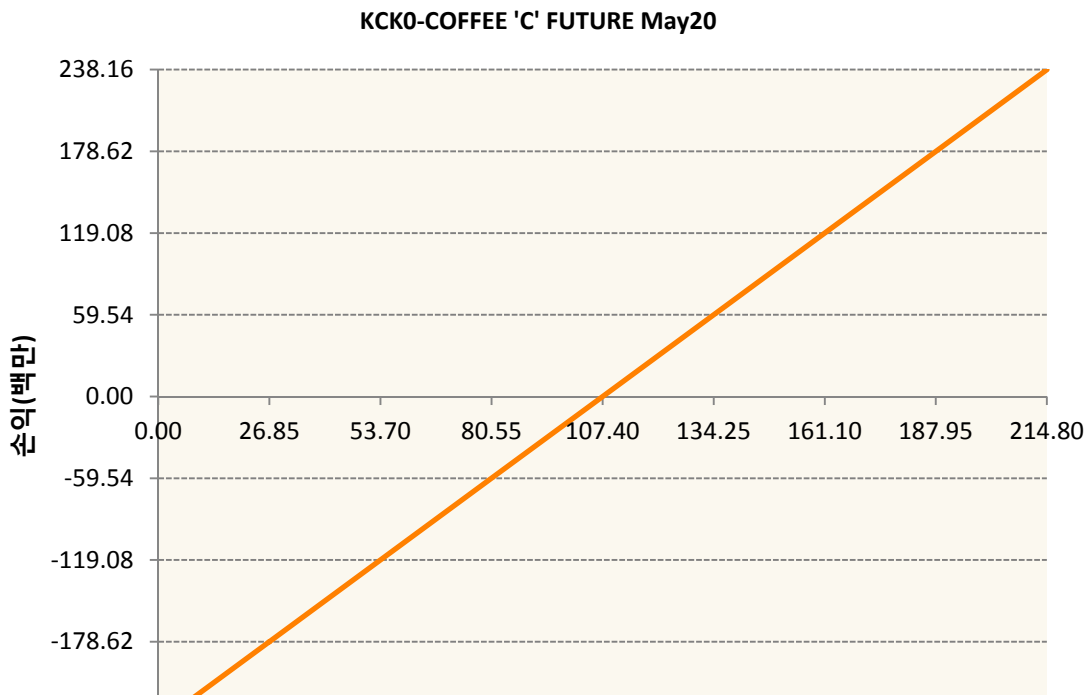
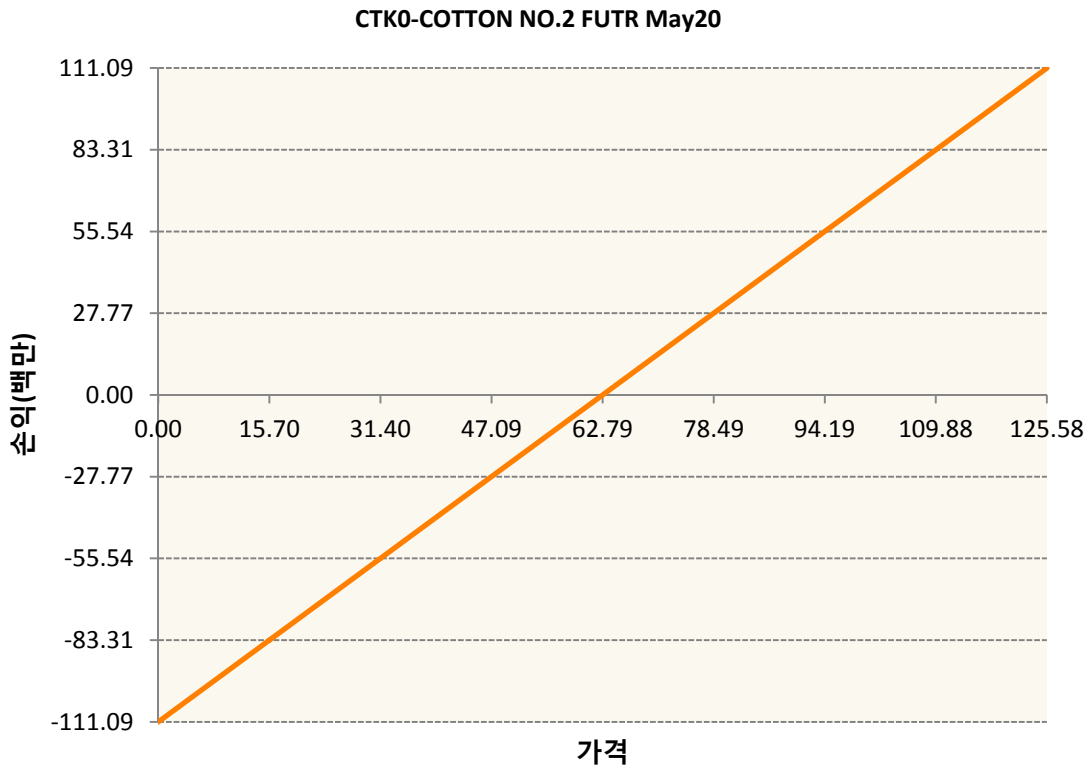
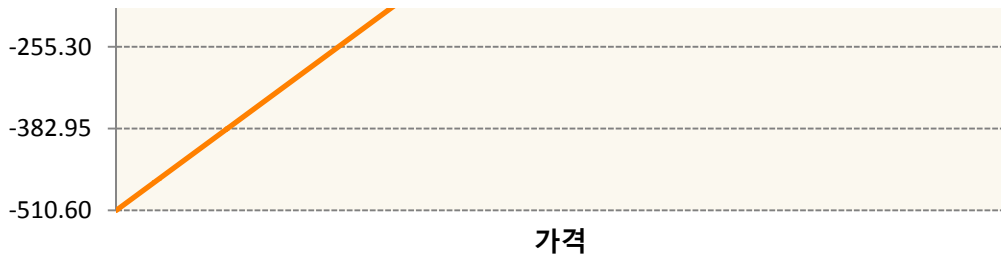
2. 만기시점의 손익구조

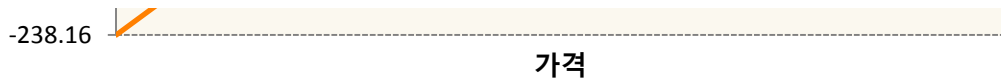
BOK0-SOYBEAN OIL FUTR May20



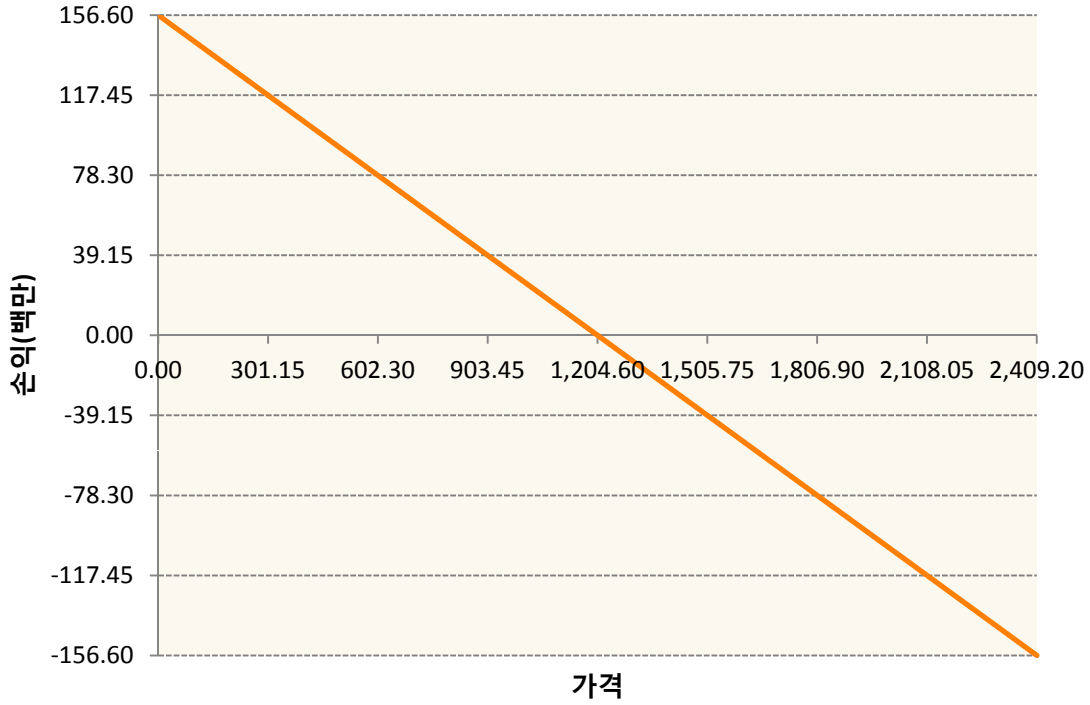
CK0-CORN FUTURE May20



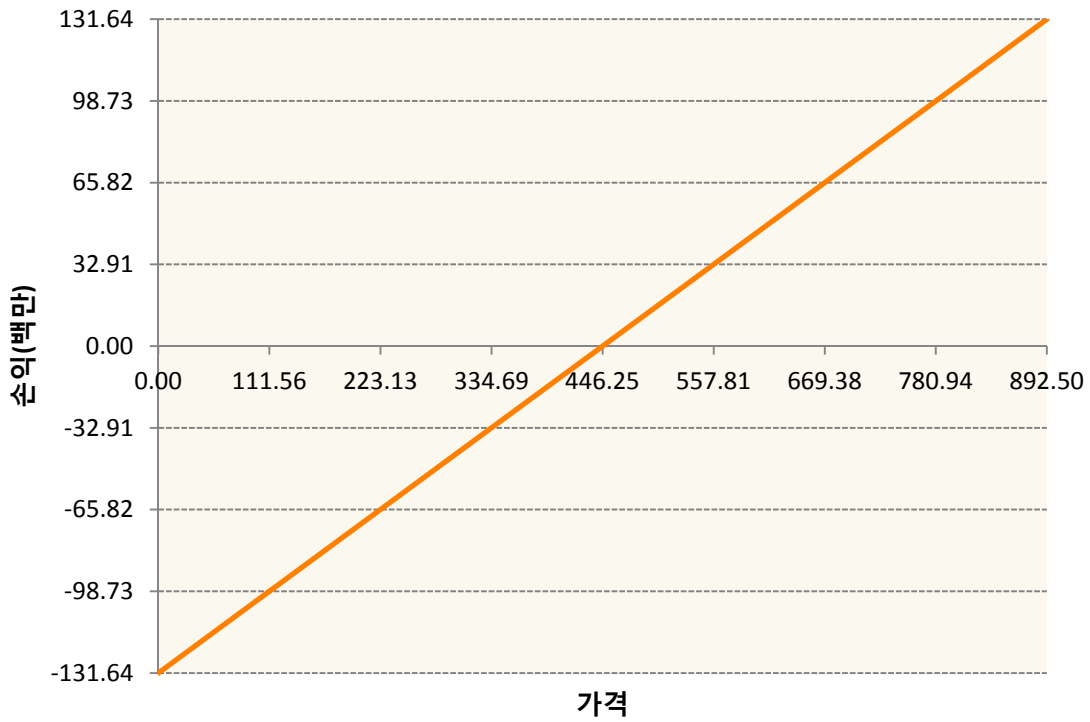




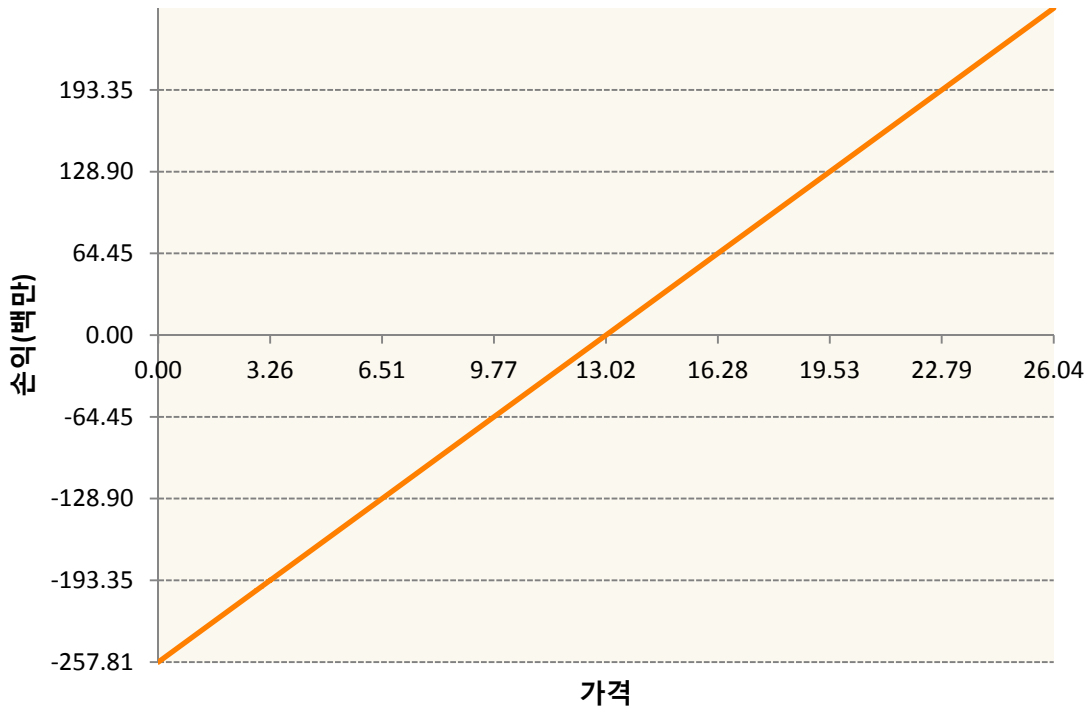
KR4175Q30009-2020-03 달러선물



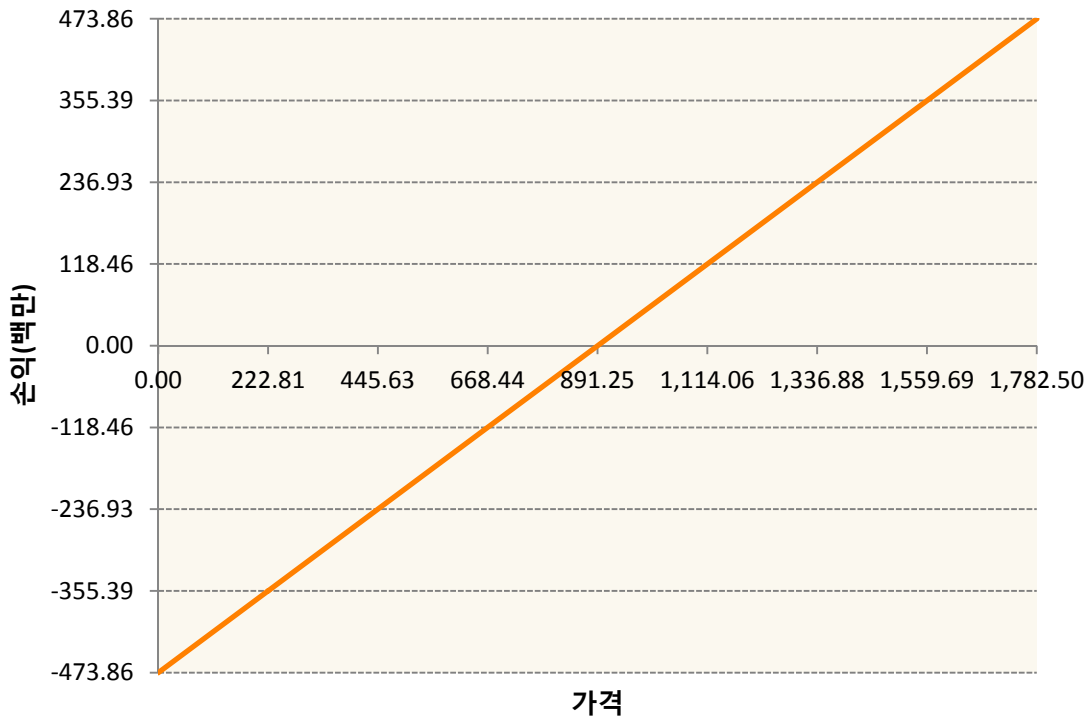
KWK0-KC HRW WHEAT FUT May20



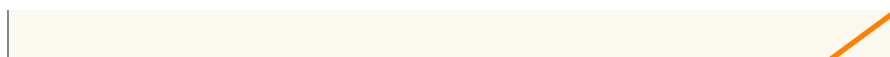
SBK0-Sugar May20

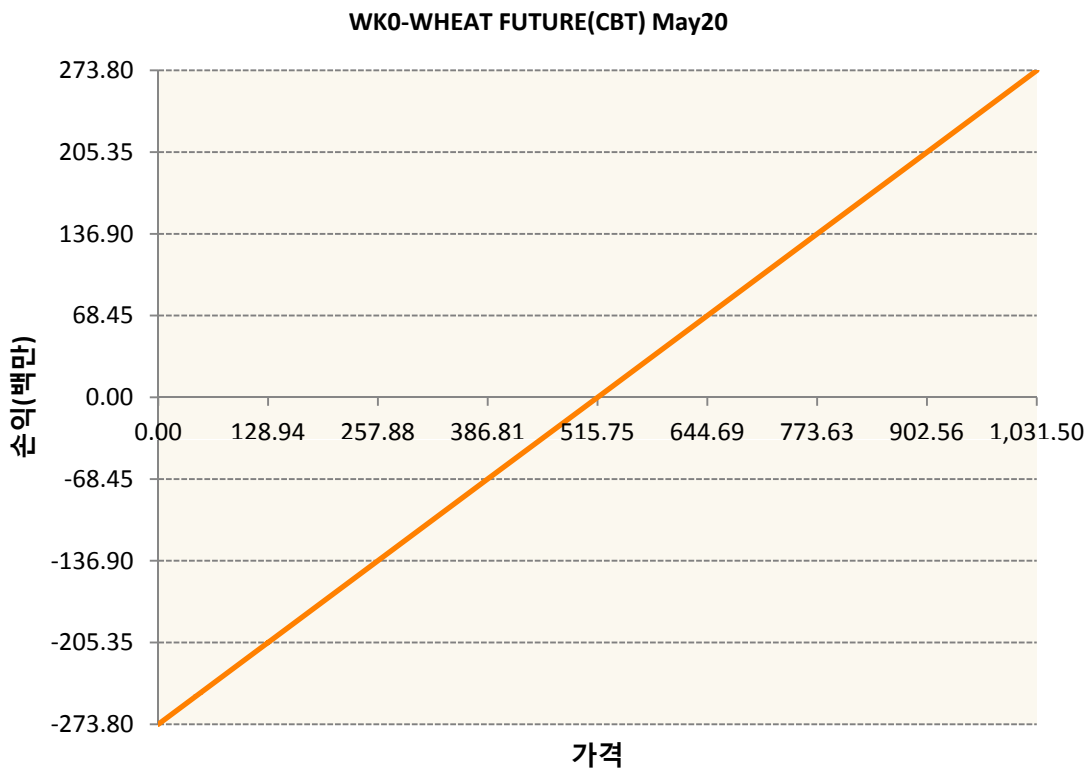
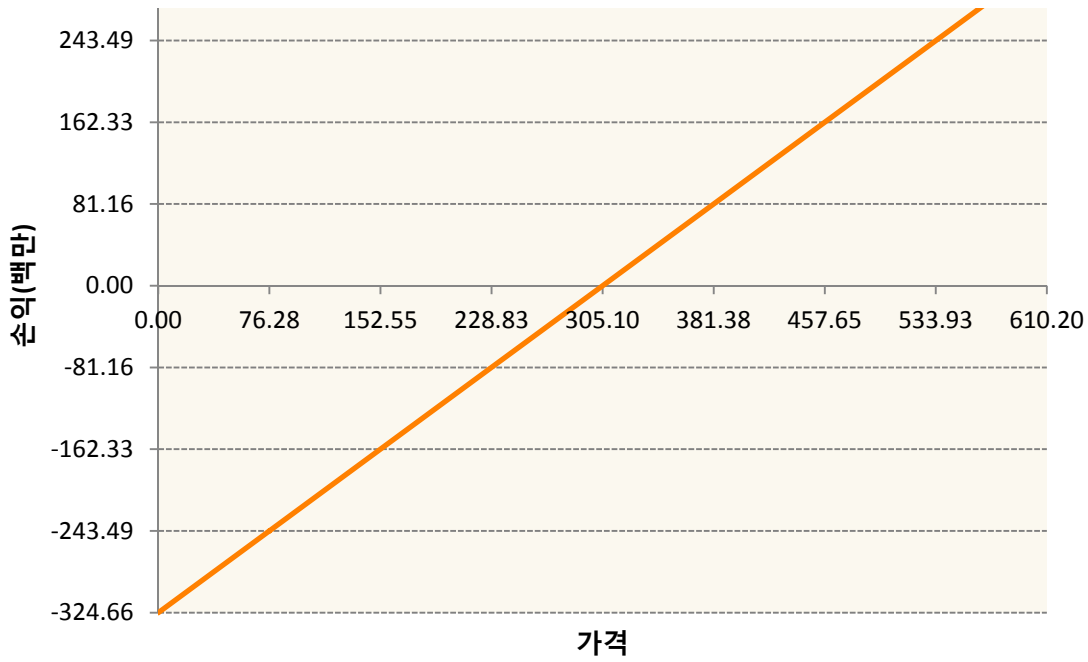


SK0-SOYBEAN FUTURE May20



SMK0-SOYBEAN MEAL FUTR May20





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOK0	SOYBEAN OIL FUTR May20	18
CK0	CORN FUTURE May20	41
CTK0	COTTON NO.2 FUTR May20	9
KCK0	COFFEE 'C' FUTURE May20	19
KR4175Q30C	2020-03 달러선물	13

KWK0	KC HRW WHEAT FUT May20	11
SBK0	Sugar May20	21
SK0	SOYBEAN FUTURE May20	38
SMK0	SOYBEAN MEAL FUTR May20	26
WK0	WHEAT FUTURE(CBT) May20	22

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

220